

当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |   |  |
|--------|---|--|
| 商品分類   | 追加型投信／海外／株式／インデックス型   |  |
| 信託期間   | 信託期間は2021年7月8日から無期限です。  |  |
| 運用方針   | 確定拠出年金法(平成13年法律第88号)に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。  |  |
| 主要運用対象 | DC外国株式<br>ESGリーダーズ<br>インデックスファンド  | 下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。                                     |
|        | 外国株式<br>ESGリーダーズ<br>インデックス<br>マザーファンド   | わが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式(預託証券(DR)を含みます。以下同じ。)を主要投資対象とします。 |
| 組入制限   | DC外国株式<br>ESGリーダーズ<br>インデックスファンド  | 株式への実質投資割合には制限を設けません。<br>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。              |
|        | 外国株式<br>ESGリーダーズ<br>インデックス<br>マザーファンド   | 株式への投資割合には制限を設けません。<br>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。                  |
| 分配方針   | 原則として毎年6月25日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。<br>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。<br>分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。 |  |

# DC外国株式ESGリーダーズ インデックスファンド

## 運用報告書(全体版)

第2期(決算日 2023年6月26日)

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。  
さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。  
今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

## 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

- 口座残高など、お客さまのお取引内容についてのお問い合わせ  
お取引のある販売会社へお問い合わせください。
- 当運用報告書についてのお問い合わせ  
フリーダイヤル:0120-668001  
(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

**【本運用報告書の記載について】**

- ・基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

## 設定以来の運用実績

| 決算期             | 基準価額<br>(分配落) |   |      | ベンチマーク<br>期中騰落率 |      | 株式組入比率 | 株式先物率<br>比 | 投資信託証券組入比率 | 純資産額         |
|-----------------|---------------|---|------|-----------------|------|--------|------------|------------|--------------|
|                 | 円             | 円 | %    | 円               | %    |        |            |            |              |
| 設定日(2021年7月8日)  | 10,000        | — | —    | 10,000          | —    | —      | —          | —          | 百万円<br>1,500 |
| 第1期(2022年6月27日) | 10,983        | 0 | 9.8  | 11,169          | 11.7 | 90.9   | 6.4        | 2.4        | 1,722        |
| 第2期(2023年6月26日) | 13,055        | 0 | 18.9 | 13,329          | 19.3 | 95.1   | 2.6        | 2.0        | 2,599        |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

### ベンチマークは、MSCI コクサイ ESG リーダーズ指数 (配当込み、円ベース) です。

MSCI コクサイ ESG リーダーズ指数は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界主要国の株式の中から、相対的に ESG 評価の高い銘柄を選定することで構築される指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

当ファンドは、MSCI Inc. (以下「MSCI」)、その関連会社、情報提供会社又は MSCI 指数の編集又は計算に関連するその他の第三者 (総称して「MSCI 当事者」) が支援、保証、販売又は販売促進するものではありません。MSCI 指数は、MSCI が独占的に所有しています。

MSCI 及び MSCI 指数の名称は、MSCI 又はその関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的のための使用について許諾されているものです。

いかなる MSCI 当事者も当ファンドの発行者、受益者、あるいはその他の個人もしくは法人に対して、ファンドの全般的又は当ファンドの特定の投資の妥当性、もしくは MSCI 指数の株式市場のパフォーマンスに追従する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明又は保証を行いません。MSCI 又はその関連会社は特定の商標、サービスマーク、商号の所有者であり、当ファンドの発行者、受益者あるいはその他の個人もしくは法人とは無関係で、MSCI が決定、構成、計算する MSCI 指数の所有者です。いかなる MSCI 当事者も、MSCI 指数について決定、構成又は計算するにあたり、当ファンドの発行者又は受益者、あるいはその他の個人もしくは法人の要求を考慮する義務を一切負いません。いかなる MSCI 当事者も、当ファンドの設定時期、価格、数量に関する決定又は償還価格及び数式の決定及び算定に参加しておらず、且つその責任を負うものではありません。さらに、いかなる MSCI 当事者も当ファンドの運営・管理、マーケティング又は募集に関連して、発行者、受益者、その他の個人もしくは法人に対して一切の義務又は責任を負いません。MSCI は、MSCI が信頼できると考える情報源から MSCI 指数の算出に使用するための情報入手するものとしますが、いずれの MSCI 当事者も、いかなる MSCI 指数又はそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI 当事者は、明示的、暗示的を問わず発行者、受益者、その他の個人もしくは法人がいかなる MSCI 指数又はそのデータを使用して得られる結果に関して、いかなる保証もしません。MSCI 当事者は、MSCI 指数もしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。

さらに、MSCI 当事者は、いかなる種類の明示的、黙示的な保証をするものではなく、MSCI 指数もしくはそのデータに関して、商品性及び特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなる場合も MSCI 当事者は、直接的、間接的、特別的、懲罰的、派生的損害、及びその他の損害 (逸失利益を含む) について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、受益者、又はその他の個人もしくは法人も、MSCI の許諾が必要かどうかを判断するために最初に MSCI に問い合わせることなく、当ファンドを支援・保証、販売又は販売促進するために MSCI の商号、商標又はサービスマークを使用又は言及することはできません。いかなる状況においても、MSCI の事前の書面による許諾なしに、いかなる個人も法人も MSCI との関係を主張することはできません。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。設定日を 10,000 として指数化したものを掲載しています。

## 当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日                  | 基 準 価 額 |       | ベンチマーク |       | 株 式 組 入 比 率 | 株 式 先 物 率 比 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |
|------------------------|---------|-------|--------|-------|-------------|-------------|---------------------|
|                        | 円       | 騰 落 率 |        | 騰 落 率 |             |             |                     |
| (当 期 首)<br>2022年 6月27日 | 10,983  | —     | 11,169 | —     | 90.9        | 6.4         | 2.4                 |
| 6月末                    | 10,904  | △0.7  | 11,058 | △1.0  | 90.8        | 6.4         | 2.4                 |
| 7月末                    | 11,306  | 2.9   | 11,430 | 2.3   | 95.1        | 2.1         | 2.6                 |
| 8月末                    | 11,232  | 2.3   | 11,398 | 2.0   | 93.1        | 4.1         | 2.4                 |
| 9月末                    | 10,673  | △2.8  | 10,788 | △3.4  | 95.5        | 2.2         | 2.2                 |
| 10月末                   | 11,644  | 6.0   | 11,752 | 5.2   | 94.3        | 3.2         | 2.2                 |
| 11月末                   | 11,379  | 3.6   | 11,518 | 3.1   | 92.5        | 4.9         | 2.2                 |
| 12月末                   | 10,698  | △2.6  | 10,922 | △2.2  | 94.3        | 3.1         | 2.3                 |
| 2023年 1月末              | 11,093  | 1.0   | 11,277 | 1.0   | 93.6        | 3.8         | 2.3                 |
| 2月末                    | 11,491  | 4.6   | 11,666 | 4.5   | 92.6        | 5.0         | 2.2                 |
| 3月末                    | 11,451  | 4.3   | 11,583 | 3.7   | 94.2        | 3.3         | 2.2                 |
| 4月末                    | 11,751  | 7.0   | 11,956 | 7.0   | 93.8        | 3.8         | 2.1                 |
| 5月末                    | 12,370  | 12.6  | 12,610 | 12.9  | 93.3        | 4.4         | 2.0                 |
| (当 期 末)<br>2023年 6月26日 | 13,055  | 18.9  | 13,329 | 19.3  | 95.1        | 2.6         | 2.0                 |

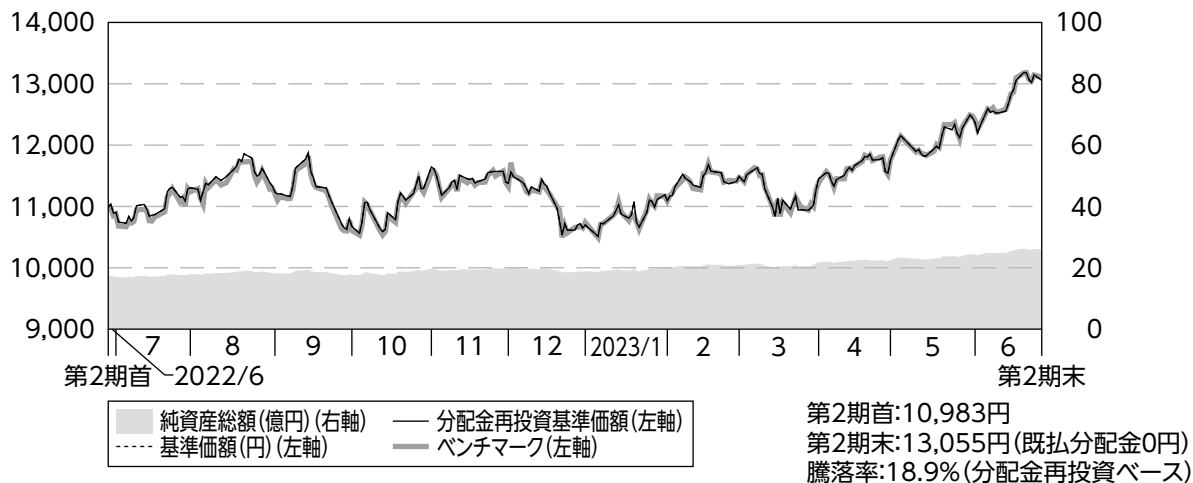
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

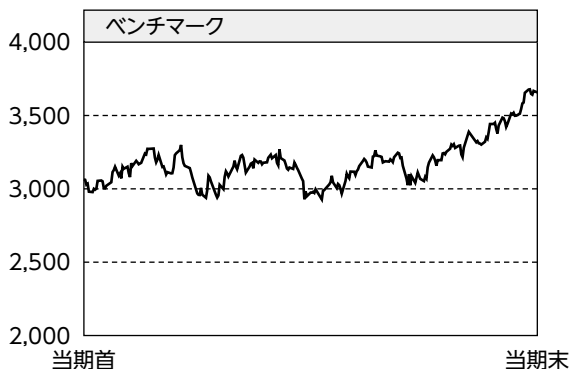


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2022年6月27日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるMSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円ベース)の動きを反映して、基準価額は上昇しました。

## 投資環境



先進国株式市場は、インフレ高進を受けた各国中央銀行の過度な金融引き締めによる景気後退リスクが意識されたことなどから、2022年10月にかけて下落しました。しかし、その後は欧米各国の物価指標の鈍化を背景に世界的な利上げサイクルが終盤に近いとの見方が強まったことや、市場予想を上回る決算を発表した大型ハイテック株が上昇したことなどから堅調に推移しました。期末にかけては、米国で債務上限停止法案が可決されたことなどが好感されて一段高となりました。

外国為替市場では、日本の貿易収支の悪化や日本と米欧との金融政策姿勢の違いが意識され、主要通貨に対して円安が進行しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

「外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド」受益証券を高位に組み入れ運用しました。

### 【「外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド」の運用経過】

ベンチマークであるMSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

#### (1) 組入比率

取引コストに留意しながらリバランスを実施し、先物を含む外国株式を高位に組み入れ運用を行いました。

#### (2) ポートフォリオ構成

ポートフォリオの構築に際しては、個別銘柄の構成比を極力ベンチマークに近づけることで連動を目指しました。

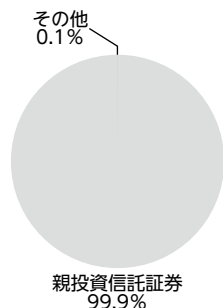
## 当ファンドの組入資産の内容

### ○組入ファンド

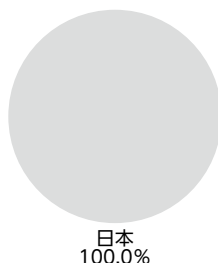
|                           | 当期末        |
|---------------------------|------------|
|                           | 2023年6月26日 |
| 外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド | 99.9%      |
| その他                       | 0.1%       |
| 組入ファンド数                   | 1          |

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

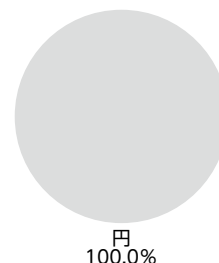
### ○資産別配分



### ○国別配分



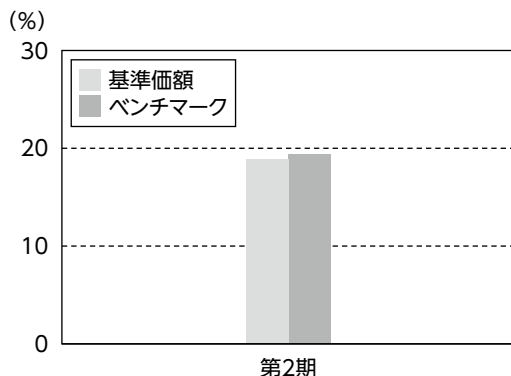
### ○通貨別配分



(注) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

差異の主な要因は、プラスの影響としては為替評価差要因\*1、マイナスの影響としては信託報酬要因、配当課税要因\*2および取引コスト要因です。

\*1 ファンドとベンチマークとで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異要因です。

\*2 ベンチマークの計算に用いられる配当金は税引前である一方、当ファンドには税引後の配当金が計上されることによる差異要因です。

## 分配金

長期的な信託財産の成長を図るため、収益分配は見送りとさせていただきます。

なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

| 項目        | 第2期                   |       |
|-----------|-----------------------|-------|
|           | 2022年6月28日~2023年6月26日 |       |
| 当期分配金     | (円)                   | —     |
| (対基準価額比率) | (%)                   | (—)   |
| 当期の収益     | (円)                   | —     |
| 当期の収益以外   | (円)                   | —     |
| 翌期繰越分配対象額 | (円)                   | 3,054 |

(注1)「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(注2)当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税引前)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注3)—印は該当がないことを示します。

## 今後の運用方針

外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式(預託証券(DR)を含みます。)に投資し、MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円ベース)に連動する投資成果を目指します。



# 1万口当たりの費用明細

| 項目               | 当期                      |         | 項目の概要  |
|------------------|-------------------------|---------|--|
|                  | (2022年6月28日~2023年6月26日) |         |  |
|                  | 金額                      | 比率      |  |
| (a) 信託報酬         | 34円                     | 0.296%  | (a) 信託報酬＝[期中の平均基準価額]×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は11,332円です。<br>信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。<br>委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価<br>交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、<br>購入後の情報提供等の対価<br>運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (投信会社)           | (17)                    | (0.148) |  |
| (販売会社)           | (13)                    | (0.115) |  |
| (受託会社)           | (4)                     | (0.033) |  |
| (b) 売買委託手数料      | 3                       | 0.024   | (b) 売買委託手数料＝ $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$<br>売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料   |
| (株式)             | (2)                     | (0.021) |  |
| (新株予約権証券)        | (-)                     | (-)     |  |
| (オプション証券等)       | (-)                     | (-)     |  |
| (新株予約権付社債(転換社債)) | (-)                     | (-)     |  |
| (投資信託証券)         | (0)                     | (0.000) |  |
| (商品)             | (-)                     | (-)     |  |
| (先物・オプション)       | (0)                     | (0.003) |  |
| (c) 有価証券取引税      | 6                       | 0.050   | (c) 有価証券取引税＝ $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$<br>有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金  |
| (株式)             | (6)                     | (0.049) |  |
| (新株予約権証券)        | (-)                     | (-)     |  |
| (オプション証券等)       | (-)                     | (-)     |  |
| (新株予約権付社債(転換社債)) | (-)                     | (-)     |  |
| (公社債)            | (-)                     | (-)     |  |
| (投資信託証券)         | (0)                     | (0.001) |  |
| (d) その他費用        | 23                      | 0.200   | (d) その他費用＝ $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$<br>保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用<br>監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用<br>その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用                         |
| (保管費用)           | (22)                    | (0.194) |  |
| (監査費用)           | (1)                     | (0.006) |  |
| (その他)            | (0)                     | (0.001) |  |
| 合計               | 66                      | 0.570   |  |

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。  
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

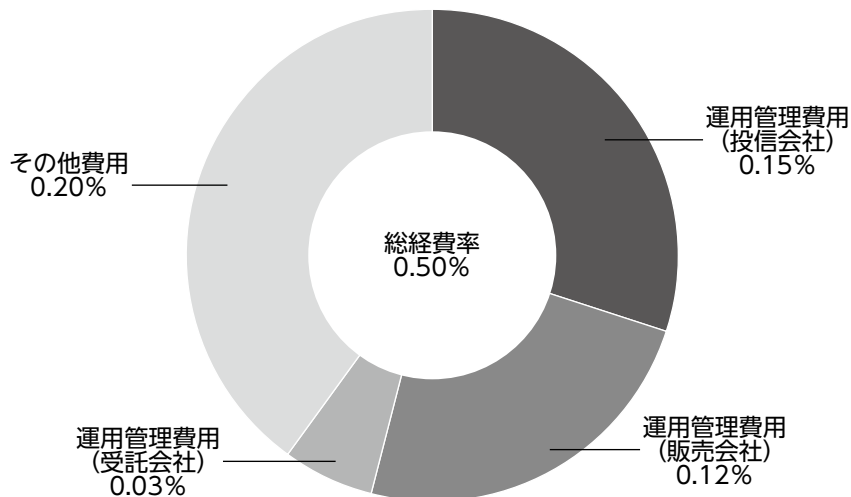
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

## <参考情報>

### 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は0.50%です。



(注1)各費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2)各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3)各比率は、年率換算した値です。

(注4)上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

## 売買および取引の状況

### <親投資信託受益証券の設定、解約状況>

|                               | 当 期           |               |              |              |
|-------------------------------|---------------|---------------|--------------|--------------|
|                               | 設 定           |               | 解 約          |              |
|                               | 口 数           | 金 額           | 口 数          | 金 額          |
| 外国株式ESGリーダーズ<br>インデックスマザーファンド | 千口<br>465,416 | 千円<br>533,423 | 千口<br>49,818 | 千円<br>58,748 |

## 株式売買比率

### ■親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

#### <外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド>

| 項 目                             | 当 期          |
|---------------------------------|--------------|
| (a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額         | 10,432,737千円 |
| (b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 7,107,655千円  |
| (c) 売 買 高 比 率(a)／(b)            | 1.46         |

(注1) (b)当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c)売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

## 利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

### ■利害関係人との取引状況

| 区 分           | 当 期             |                 |            | 期               |                 |            |
|---------------|-----------------|-----------------|------------|-----------------|-----------------|------------|
|               | 買付額等A           | うち利害関係人との取引状況B  | B/A        | 売付額等C           | うち利害関係人との取引状況D  | D/C        |
| 金 銭 信 託       | 百万円<br>0.000292 | 百万円<br>0.000292 | %<br>100.0 | 百万円<br>0.000292 | 百万円<br>0.000292 | %<br>100.0 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 826             | 106             | 12.8       | 826             | 105             | 12.7       |

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

### <外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド>

| 区 分           | 当 期          |                |          | 期          |                |        |
|---------------|--------------|----------------|----------|------------|----------------|--------|
|               | 買付額等A        | うち利害関係人との取引状況B | B/A      | 売付額等C      | うち利害関係人との取引状況D | D/C    |
| 為 替 直 物 取 引   | 百万円<br>8,565 | 百万円<br>105     | %<br>1.2 | 百万円<br>412 | 百万円<br>-       | %<br>- |
| 金 銭 信 託       | 0.000148     | 0.000148       | 100.0    | 0.000148   | 0.000148       | 100.0  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 2,258        | 245            | 10.9     | 2,255      | 244            | 10.8   |

<平均保有割合 25.9%>

(注1)平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## 自社による当ファンドの設定・解約状況

| 当 期 首 残 高<br>(元) | 当 期 設 定<br>本 元 | 当 期 解 約<br>本 元 | 当 期 末 残 高<br>(元) | 取 引 の 理 由   |
|------------------|----------------|----------------|------------------|-------------|
| 千円<br>1,500,000  | 千円<br>-        | 千円<br>-        | 千円<br>1,500,000  | 当初設定時における取得 |

## 組入資産の明細

### <親投資信託残高>

|                           | 当 期 首 (前 期 末)   | 当 期 末           |                 |
|---------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|
|                           | 口 数             | 口 数             | 評 価 額           |
| 外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド | 千口<br>1,562,498 | 千口<br>1,978,096 | 千円<br>2,598,032 |

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、9,095,211千口です。

※ 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## 投資信託財産の構成

| 項 目                       | 当 期 末     |       |
|---------------------------|-----------|-------|
|                           | 評 価 額     | 比 率   |
|                           | 千円        | %     |
| 外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド | 2,598,032 | 99.8  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他   | 4,715     | 0.2   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額           | 2,602,747 | 100.0 |

(注1) 外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(11,940,699千円)の投資信託財産総額(11,946,659千円)に対する比率は100.0%です。

(注2) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

|                     |                   |                    |
|---------------------|-------------------|--------------------|
| 1米ドル=143.49円        | 1カナダドル=108.95円    | 1ユーロ=156.48円       |
| 1イギリスポンド=182.69円    | 1スイスフラン=160.15円   | 1スウェーデンクローナ=13.40円 |
| 1ノルウェークローネ=13.28円   | 1デンマーククローネ=21.01円 | 1オーストラリアドル=95.77円  |
| 1ニュージーランドドル=88.32円  | 1香港ドル=18.32円      | 1シンガポールドル=106.19円  |
| 1イスラエルシェケル=39.5827円 |                   |                    |

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

| 項 目                                | 当 期 末<br>2023年6月26日現在 |
|------------------------------------|-----------------------|
| (A)資 産                             | 2,602,747,788円        |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等                    | 4,715,356             |
| 外国株式ESGリーダーズインデックス<br>マザーファンド(評価額) | 2,598,032,432         |
| (B)負 債                             | 3,406,703             |
| 未 払 解 約 金                          | 140,577               |
| 未 払 信 託 報 酬                        | 3,206,789             |
| 未 払 利 息                            | 11                    |
| そ の 他 未 払 費 用                      | 59,326                |
| (C)純 資 産 総 額(A-B)                  | 2,599,341,085         |
| 元 本                                | 1,991,136,651         |
| 次 期 繰 越 損 益 金                      | 608,204,434           |
| (D)受 益 権 総 口 数                     | 1,991,136,651口        |
| 1万口当たり基準価額(C/D)                    | 13,055円               |

### ■損益の状況

| 項 目                     | 当 期<br>自 2022年6月28日<br>至 2023年6月26日 |
|-------------------------|-------------------------------------|
| (A)配 当 等 収 益            | △1,576円                             |
| 受 取 利 息                 | 8                                   |
| 支 払 利 息                 | △1,584                              |
| (B)有 価 証 券 売 買 損 益      | 392,979,673                         |
| 売 買 益                   | 406,081,847                         |
| 売 買 損                   | △13,102,174                         |
| (C)信 託 報 酬 等            | △6,079,378                          |
| (D)当 期 繰 越 損 益 金(A+B+C) | 386,898,719                         |
| (E)前 期 繰 越 損 益 金        | 135,633,934                         |
| (F)追 加 信 託 差 損 益 金      | 85,671,781                          |
| (配 当 等 相 当 額)           | (50,984,670)                        |
| (売 買 損 益 相 当 額)         | (34,687,111)                        |
| (G)計 (D+E+F)            | 608,204,434                         |
| (H)収 益 分 配 金            | 0                                   |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G+H)      | 608,204,434                         |
| 追 加 信 託 差 損 益 金         | 85,671,781                          |
| (配 当 等 相 当 額)           | (52,012,345)                        |
| (売 買 損 益 相 当 額)         | (33,659,436)                        |
| 分 配 準 備 積 立 金           | 522,532,653                         |

(注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は1,567,913,907円、期中追加設定元本額は566,857,313円、期中一部解約元本額は143,634,569円です。

※分配金の計算過程

| 項   | 目                           | 当 | 期              |
|-----|-----------------------------|---|----------------|
| (A) | 配当等収益額(費用控除後)               |   | 37,760,096円    |
| (B) | 有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)  |   | 349,138,623円   |
| (C) | 収益調整金額                      |   | 85,671,781円    |
| (D) | 分配準備積立金額                    |   | 135,633,934円   |
| (E) | 分配対象収益額(A+B+C+D)            |   | 608,204,434円   |
| (F) | 期末残存口数                      |   | 1,991,136,651口 |
| (G) | 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000) |   | 3,054円         |
| (H) | 分配金額(1万口当たり)                |   | －円             |
| (I) | 収益分配金金額(F×H/10,000)         |   | －円             |

## お知らせ

---

該当事項はありません。

# 外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド

## 運用報告書

第2期（決算日 2023年6月26日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

|        |   |
|--------|---|
| 信託期間   | 信託期間は2021年7月8日から無期限です。                                    |
| 運用方針   | 投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。                               |
| 主要運用対象 | わが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式(預託証券(DR)を含みます。)を主要投資対象とします。 |
| 組入制限   | 株式への投資割合には制限を設けません。<br>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。             |

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未滿は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

## 設定以来の運用実績

| 決算期             | 基準価額   |      | ベンチマーク |      | 株式組入率 | 株式先比率 | 株式物率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産総額        |
|-----------------|--------|------|--------|------|-------|-------|------|------------|--------------|
|                 | 円      | 騰落率  | 円      | 騰落率  |       |       |      |            |              |
| 設定日(2021年7月8日)  | 10,000 | —    | 10,000 | —    | —     | —     | —    | —          | 百万円<br>1,499 |
| 第1期(2022年6月27日) | 11,016 | 10.2 | 11,169 | 11.7 | 91.0  | 6.4   | 2.4  |            | 1,721        |
| 第2期(2023年6月26日) | 13,134 | 19.2 | 13,329 | 19.3 | 95.2  | 2.6   | 2.0  |            | 11,945       |

(注)株式先物比率は「買建比率ー売建比率」で算出しております。

### ベンチマークは、MSCI コクサイ ESG リーダーズ指数(配当込み、円ベース)です。

MSCI コクサイ ESG リーダーズ指数は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界主要国の株式の中から、相対的にESG評価の高い銘柄を選定することで構築される指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

当ファンドは、MSCI Inc. (以下「MSCI」)、その関連会社、情報提供会社又はMSCI指数の編集又は計算に関連するその他の第三者(総称して「MSCI当事者」)が支援、保証、販売又は販売促進するものではありません。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。

MSCI及びMSCI指数の名称は、MSCI又はその関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的のための使用について許諾されているものです。

いかなるMSCI当事者も当ファンドの発行者、受益者、あるいはその他の個人もしくは法人に対して、ファンドの全般的又は当ファンドの特定の投資の妥当性、もしくはMSCI指数の株式市場のパフォーマンスに追従する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明又は保証を行いません。MSCI又はその関連会社は特定の商標、サービスマーク、商号の所有者であり、当ファンドの発行者、受益者あるいはその他の個人もしくは法人とは無関係で、MSCIが決定、構成、計算するMSCI指数の所有者です。いかなるMSCI当事者も、MSCI指数について決定、構成又は計算するにあたり、当ファンドの発行者又は受益者、あるいはその他の個人もしくは法人の要求を考慮する義務を一切負いません。いかなるMSCI当事者も、当ファンドの設定時期、価格、数量に関する決定又は償還価格及び数式の決定及び算定に参加しておらず、且つその責任を負うものではありません。さらに、いかなるMSCI当事者も当ファンドの運営・管理、マーケティング又は募集に関連して、発行者、受益者、その他の個人もしくは法人に対して一切の義務又は責任を負いません。MSCIは、MSCIが信頼できると考える情報源からMSCI指数の算出に使用するための情報を入手するものとしますが、いずれのMSCI当事者も、いかなるMSCI指数又はそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI当事者は、明示的、暗示的を問わず発行者、受益者、その他の個人もしくは法人がいかなるMSCI指数又はそのデータを使用して得られる結果に関して、いかなる保証もしません。MSCI当事者は、MSCI指数もしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。

さらに、MSCI当事者は、いかなる種類の明示的、黙示的な保証をするものではなく、MSCI指数もしくはそのデータに関して、商品性及び特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなる場合もMSCI当事者は、直接的、間接的、特別的、懲罰的、派生的損害、及びその他の損害(逸失利益を含む)について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、受益者、又はその他の個人もしくは法人も、MSCIの許諾が必要かどうかを判断するために最初にMSCIに問い合わせることなく、当ファンドを支援・保証、販売又は販売促進するためにMSCIの商号、商標又はサービスマークを使用又は言及することはできません。いかなる状況においても、MSCIの事前の書面による許諾なしに、いかなる個人も法人もMSCIとの関係を主張することはできません。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。



## 当期中の基準価額と市況の推移

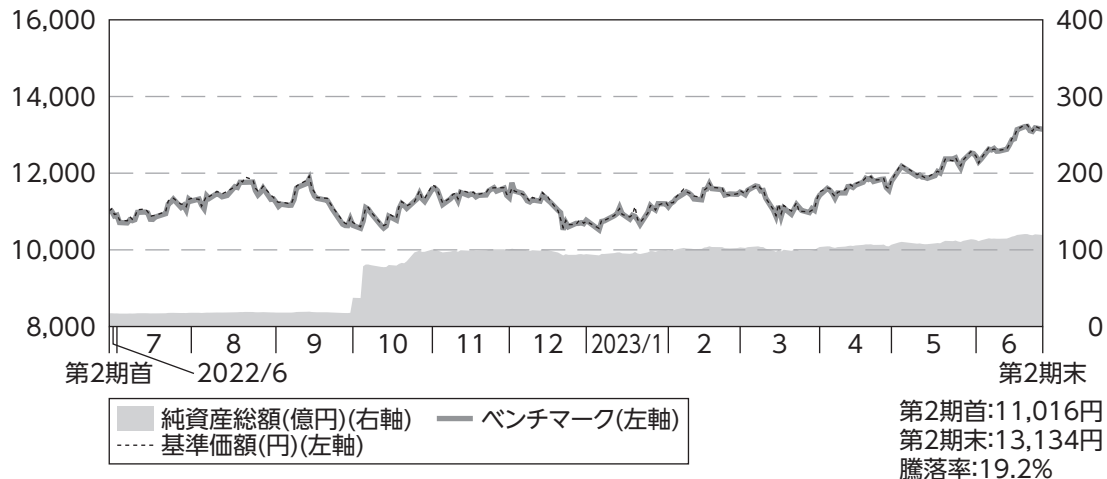
| 年 月 日                  | 基 準 価 額     |        | ベンチマーク |        | 株組比       | 式入率      | 株先比      | 式物率 | 投資信託<br>組入比率 |
|------------------------|-------------|--------|--------|--------|-----------|----------|----------|-----|--------------|
|                        | 円           | 騰落率    |        | 騰落率    |           |          |          |     |              |
| (当 期 首)<br>2022年 6月27日 | 円<br>11,016 | %<br>ー |        | %<br>ー | %<br>91.0 | %<br>6.4 | %<br>2.4 |     |              |
| 6月末                    | 10,937      | △0.7   | 11,058 | △1.0   | 90.9      | 6.4      | 2.4      |     |              |
| 7月末                    | 11,343      | 3.0    | 11,430 | 2.3    | 95.2      | 2.1      | 2.6      |     |              |
| 8月末                    | 11,272      | 2.3    | 11,398 | 2.0    | 93.1      | 4.1      | 2.4      |     |              |
| 9月末                    | 10,713      | △2.8   | 10,788 | △3.4   | 95.6      | 2.2      | 2.2      |     |              |
| 10月末                   | 11,691      | 6.1    | 11,752 | 5.2    | 94.4      | 3.2      | 2.2      |     |              |
| 11月末                   | 11,428      | 3.7    | 11,518 | 3.1    | 92.6      | 4.9      | 2.2      |     |              |
| 12月末                   | 10,746      | △2.5   | 10,922 | △2.2   | 94.4      | 3.1      | 2.3      |     |              |
| 2023年 1月末              | 11,146      | 1.2    | 11,277 | 1.0    | 93.6      | 3.8      | 2.3      |     |              |
| 2月末                    | 11,549      | 4.8    | 11,666 | 4.5    | 92.6      | 5.0      | 2.2      |     |              |
| 3月末                    | 11,512      | 4.5    | 11,583 | 3.7    | 94.2      | 3.3      | 2.2      |     |              |
| 4月末                    | 11,816      | 7.3    | 11,956 | 7.0    | 93.9      | 3.8      | 2.2      |     |              |
| 5月末                    | 12,442      | 12.9   | 12,610 | 12.9   | 93.4      | 4.4      | 2.0      |     |              |
| (当 期 末)<br>2023年 6月26日 | 13,134      | 19.2   | 13,329 | 19.3   | 95.2      | 2.6      | 2.0      |     |              |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は「買建比率ー売建比率」で算出しております。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移



(注)ベンチマークは、2022年6月27日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるMSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円ベース)の動きを反映して、基準価額は上昇しました。

## 投資環境



先進国株式市場は、インフレ高進を受けた各国中央銀行の過度な金融引き締めによる景気後退リスクが意識されたことなどから、2022年10月にかけて下落しました。しかし、その後は欧米各国の物価指標の鈍化を背景に世界的な利上げサイクルが終盤に近いとの見方が強まったことや、市場予想を上回る決算を発表した大型ハイテク株が上昇したことなどから堅調に推移しました。期末にかけては、米国で債務上限停止法案が可決されたことなどが好感されて一段高となりました。

外国為替市場では、日本の貿易収支の悪化や日本と米欧との金融政策姿勢の違いが意識され、主要通貨に対して円安が進行しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるMSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

### (1) 組入比率

取引コストに留意しながらリバランスを実施し、先物を含む外国株式を高位に組み入れ運用を行いました。

### (2) ポートフォリオ構成

ポートフォリオの構築に際しては、個別銘柄の構成比を極力ベンチマークに近づけることで連動を目指しました。

## 当ファンドの組入資産の内容

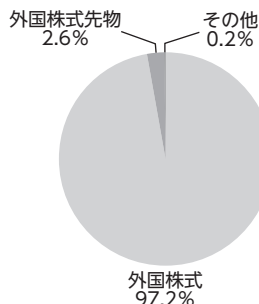
### ○上位10銘柄

| 順位 | 銘柄名               | 国・地域 | 組入比率 |
|----|-------------------|------|------|
| 1  | MICROSOFT CORP    | アメリカ | 8.8% |
| 2  | NVIDIA CORP       | アメリカ | 3.9% |
| 3  | TESLA INC         | アメリカ | 2.7% |
| 4  | ALPHABET INC-CL A | アメリカ | 2.7% |
| 5  | ALPHABET INC-CL C | アメリカ | 2.5% |
| 6  | S&P 500 EMIN 2309 | アメリカ | 2.1% |

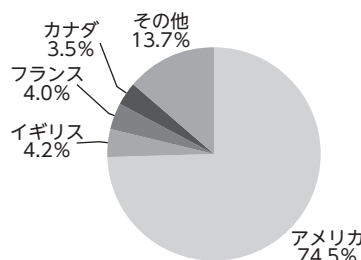
| 順位    | 銘柄名                     | 国・地域 | 組入比率 |
|-------|-------------------------|------|------|
| 7     | JOHNSON & JOHNSON       | アメリカ | 1.6% |
| 8     | VISA INC-CLASS A SHARES | アメリカ | 1.4% |
| 9     | ELI LILLY & CO          | アメリカ | 1.4% |
| 10    | PROCTER & GAMBLE CO     | アメリカ | 1.3% |
| 組入銘柄数 |                         | 604  |      |

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

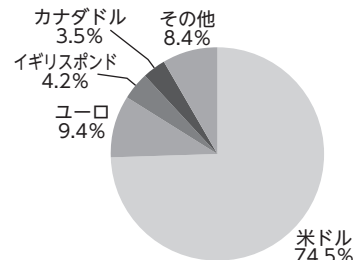
### ○資産別配分



### ○国別配分



### ○通貨別配分

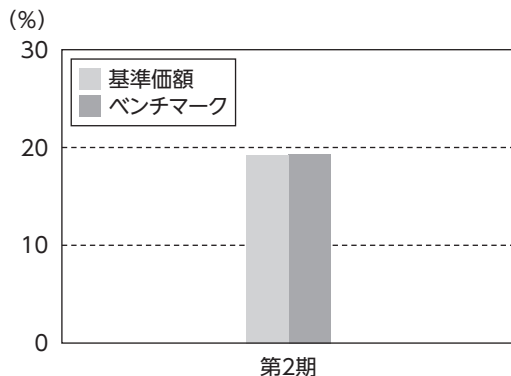


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未取・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して2.6%買建てております。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

差異の主な要因は、プラスの影響としては為替評価差要因<sup>\*1</sup>、マイナスの影響としては配当課税要因<sup>\*2</sup>および取引コスト要因です。

<sup>\*1</sup> ファンドとベンチマークとで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異要因です。

<sup>\*2</sup> ベンチマークの計算に用いられる配当金は税引前である一方、当ファンドには税引後の配当金が計上されることによる差異要因です。

## 今後の運用方針

主としてわが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式(預託証券(DR)を含みます。)に投資し、MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円ベース)に連動する投資成果を目指します。

## 1万口当たりの費用明細

| 項目   | 当期  |   | 項目の概要   |
|--|---|---|---|
|  | (2022年6月28日~2023年6月26日)                             |   |   |
|  | 金額  | 比率  |   |
| (a) 売買委託手数料<br>(株式)<br>(新株予約権証券)<br>(オプション証券等)<br>(新株予約権付社債(転換社債))<br>(投資信託証券)<br>(商品)<br>(先物・オプション) | 3円<br>(2)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(0)<br>(-)<br>(0) | 0.024%<br>(0.021)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(0.000)<br>(-)<br>(0.002) | (a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$<br>売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料   |
| (b) 有価証券取引税<br>(株式)<br>(新株予約権証券)<br>(オプション証券等)<br>(新株予約権付社債(転換社債))<br>(公社債)<br>(投資信託証券)              | 6<br>(6)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(0)         | 0.050<br>(0.050)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(0.001)             | (b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$<br>有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金  |
| (c) その他費用<br><br>(保管費用)<br><br>(監査費用)<br>(その他)   | 19<br><br>(19)<br><br>(-)<br>(0)                    | 0.165<br><br>(0.164)<br><br>(-)<br>(0.000)                          | (c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$<br>保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用<br>監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用<br>その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合計   | 28  | 0.239   |   |

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(11,382円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<株 式>

|   |               | 当 期                 |                                |              |                    |
|---|---------------|---------------------|--------------------------------|--------------|--------------------|
|   |               | 買 付                 |                                | 売 付          |                    |
|   |               | 株 数                 | 金 額                            | 株 数          | 金 額                |
| 外 | ア メ リ カ       | 百株<br>4,483<br>(81) | 千米ドル<br>45,268<br>(△2)         | 百株<br>595    | 千米ドル<br>4,045      |
|   | カ ナ ダ         | 559<br>(15)         | 千カナダドル<br>3,210<br>(-)         | 39           | 千カナダドル<br>145      |
|   | ド イ ツ         | 254<br>(-)          | 千ユーロ<br>1,336<br>(△1)          | 56           | 千ユーロ<br>709        |
|   | イ タ リ ア       | 772                 | 387                            | 481          | 115                |
|   | フ ラ ン ス       | 451<br>(-)          | 2,702<br>(△0.22149)            | 82           | 538                |
|   | オ ラ ン ダ       | 349<br>(△5)         | 1,149<br>(△61)                 | 10           | 50                 |
|   | ス ペ イ ン       | 421<br>(210)        | 472<br>(3)                     | 243<br>(206) | 232<br>(3)         |
|   | ベ ル ギ ー       | 14                  | 72                             | 2            | 31                 |
|   | オ ー ス ト リ ア   | 8                   | 34                             | 3            | 11                 |
|   | ル ク セ ン ブ ル ク | 15                  | 21                             | -            | -                  |
|   | フ ィ ン ラ ン ド   | 263                 | 297                            | 16           | 70                 |
|   | ア イ ル ラ ン ド   | 33                  | 140                            | -            | -                  |
|   | ポ ル ト ガ ル     | 19                  | 26                             | -            | -                  |
|   | そ の 他         | -<br>(5)            | -<br>(61)                      | -            | -                  |
| 国 | イ ギ リ ス       | 4,526<br>(22)       | 千イギリスポンド<br>2,485<br>(-)       | 336          | 千イギリスポンド<br>527    |
|   | ス イ ス         | 195<br>(6)          | 千スイスフラン<br>2,328<br>(△0.97763) | 46           | 千スイスフラン<br>901     |
|   | ス ウ ェ ー デ ン   | 619<br>(10)         | 千スウェーデンクローナ<br>6,974<br>(-)    | 102          | 千スウェーデンクローナ<br>595 |
|   | ノ ル ウ ェ ー     | 141                 | 千ノルウェークローネ<br>2,337            | -            | 千ノルウェークローネ<br>-    |
|   | デ ン マ ー ク     | 98                  | 千デンマーククローネ<br>6,338            | 7            | 千デンマーククローネ<br>151  |
|   | オ ー ス ト ラ リ ア | 1,027<br>(0.9)      | 千オーストラリアドル<br>1,993<br>(-)     | 209          | 千オーストラリアドル<br>602  |

|   |          | 当 期          |                               |               |                              |
|---|----------|--------------|-------------------------------|---------------|------------------------------|
|   |          | 買 付          |                               | 売 付           |                              |
|   |          | 株 数          | 金 額                           | 株 数           | 金 額                          |
| 外 | ニュージーランド | 152          | 千ニュージーランドドル<br>122            | 53            | 千ニュージーランドドル<br>72            |
|   | 香 港      | 1,073        | 千香港ドル<br>3,235                | 80            | 千香港ドル<br>163                 |
| 国 | シンガポール   | 211<br>(821) | 千シンガポールドル<br>183<br>(0.00487) | 874<br>(0.65) | 千シンガポールドル<br>43<br>(0.43554) |
|   | イスラエル    | 38           | 千イスラエルシェケル<br>119             | —             | 千イスラエルシェケル<br>—              |

(注1)金額は受渡代金です。

(注2) ( )内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

<投資信託受益証券、投資証券>

|      |                               | 当 期            |              |     |        |
|------|-------------------------------|----------------|--------------|-----|--------|
|      |                               | 買 付            |              | 売 付 |        |
|      |                               | 口 数            | 金 額          | 口 数 | 金 額    |
| 外 国  |                               |                |              |     |        |
| アメリカ |                               | 千口             | 千米ドル         | 千口  | 千米ドル   |
|      | BOSTON PROPERTIES             | 0.452          | 32           | —   | —      |
|      | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC | 1<br>(△0.507)  | 24<br>(—)    | —   | —      |
|      | PROLOGIS INC                  | 2              | 267          | —   | —      |
|      | CROWN CASTLE INC              | 1              | 161          | —   | —      |
|      | HEALTHPEAK PROPERTIES INC     | 1              | 30           | —   | —      |
|      | WELLTOWER INC                 | 1              | 84           | —   | —      |
|      | IRON MOUNTAIN INC             | 0.95           | 50           | —   | —      |
|      | VENTAS INC                    | 0.918          | 36           | 1   | 50     |
|      | DIGITAL REALTY TRUST INC      | 0.95           | 97           | —   | —      |
|      | AMERICAN TOWER CORPORATION    | 1              | 252          | —   | —      |
|      | EQUINIX INC                   | 0.242          | 140          | —   | —      |
|      | SBA COMMUNICATIONS CORP       | 0.276          | 76           | —   | —      |
|      | 小 計                           | 12<br>(△0.507) | 1,253<br>(—) | 1   | 50     |
| カナダ  |                               | 千口             | 千カナダドル       | 千口  | 千カナダドル |
|      | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA  | 0.236          | 9            | —   | —      |
|      | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR   | 0.55           | 11           | —   | —      |
|      | 小 計                           | 0.786          | 20           | —   | —      |

|  | 当 期           |                  |       |            |
|--|---------------|------------------|-------|------------|
|  | 買 付           |                  | 売 付   |            |
|  | 口 数           | 金 額              | 口 数   | 金 額        |
| フランス                                   | 千口            | 千ユーロ             | 千口    | 千ユーロ       |
| KLEPIERRE                              | 0.466         | 8                | —     | —          |
| GECINA SA                              | 0.099         | 7                | —     | —          |
| COVIVIO (FP)                           | 0.13          | 6                | 0.156 | 7          |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD              | 0.245         | 10               | 0.305 | 13         |
| 小 計                                    | 0.94          | 33               | 0.461 | 20         |
| ユ ー ロ 計                                | 0.94          | 33               | 0.461 | 20         |
| イギリス                                   | 千口            | 千イギリスポンド         | 千口    | 千イギリスポンド   |
| BRITISH LAND CO PLC                    | 1             | 6                | 2     | 7          |
| SEGRO PLC                              | 3             | 22               | —     | —          |
| LAND SECURITIES GROUP PLC              | 1             | 6                | 1     | 10         |
| 小 計                                    | 6             | 35               | 4     | 18         |
| オーストラリア                                | 千口            | 千オーストラリアドル       | 千口    | 千オーストラリアドル |
| MIRVAC GROUP                           | 8             | 15               | —     | —          |
| APA GROUP                              | 2             | 22               | —     | —          |
| GPT GROUP                              | 3             | 15               | —     | —          |
| STOCKLAND                              | 4             | 16               | —     | —          |
| DEXUS                                  | 2             | 16               | —     | —          |
| GOODMAN GROUP                          | 4             | 81               | —     | —          |
| VICINITY CENTERS                       | 7             | 13               | —     | —          |
| LENDLEASE GROUP                        | 1             | 12               | —     | —          |
| SCENTRE GROUP                          | 12            | 31               | —     | —          |
| 小 計                                    | 48            | 226              | —     | —          |
| 香港                                     | 千口            | 千香港ドル            | 千口    | 千香港ドル      |
| HKT TRUST AND HKT LTD                  | 9             | 82               | —     | —          |
| 小 計                                    | 9             | 82               | —     | —          |
| シンガポール                                 | 千口            | 千シンガポールドル        | 千口    | 千シンガポールドル  |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 12<br>(—)     | 23<br>(△0.01694) | —     | —          |
| CAPITALAND ASCOTT TRUST                | —<br>(0.444)  | —<br>(0.43067)   | 0.444 | 0.46985    |
| 小 計                                    | 12<br>(0.444) | 23<br>(0.41373)  | 0.444 | 0.46985    |

(注1)金額は受渡代金です。

(注2) ( )内は合併・分割・減資・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。



<先物取引の種類別取引状況>

| 種 類 別        | 当 期          |              |          |          |
|--------------|--------------|--------------|----------|----------|
|              | 買 建          |              | 売 建      |          |
|              | 新規買付額        | 決 済 額        | 新規売付額    | 決 済 額    |
| 外国<br>株式先物取引 | 百万円<br>2,412 | 百万円<br>2,271 | 百万円<br>- | 百万円<br>- |

(注)金額は受渡代金です。

株式売買比率

<株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合>

| 項 目                             | 当 期          |
|---------------------------------|--------------|
| (a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額         | 10,432,737千円 |
| (b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 7,107,655千円  |
| (c) 売 買 高 比 率(a)/(b)            | 1.46         |

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

■利害関係人との取引状況

| 区 分           | 当            |                |          | 期          |                |        |
|---------------|--------------|----------------|----------|------------|----------------|--------|
|               | 買付額等A        | うち利害関係人との取引状況B | B/A      | 売付額等C      | うち利害関係人との取引状況D | D/C    |
| 為 替 直 物 取 引   | 百万円<br>8,565 | 百万円<br>105     | %<br>1.2 | 百万円<br>412 | 百万円<br>-       | %<br>- |
| 金 銭 信 託       | 0.000148     | 0.000148       | 100.0    | 0.000148   | 0.000148       | 100.0  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 2,258        | 245            | 10.9     | 2,255      | 244            | 10.8   |

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

組入資産の明細

<外国株式>

| 銘柄                            | 当期首(前期末)    | 当           |           | 期 末                 |        | 業 種                    |
|-------------------------------|-------------|-------------|-----------|---------------------|--------|------------------------|
|                               | 株 数<br>(百株) | 株 数<br>(百株) | 評 価 額     |                     |        |                        |
|                               |             |             | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額<br>(千円) |        |                        |
| (アメリカ)                        |             |             |           | 千米ドル                |        |                        |
| ABIOMED INC                   | 0.21        | —           | —         | —                   | —      | ヘルスケア機器・サービス           |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP   | 4           | 28          | 367       | 52,744              | 52,744 | ソフトウェア・サービス            |
| ADOBE INC                     | 2           | 14          | 682       | 97,860              | 97,860 | ソフトウェア・サービス            |
| CHUBB LTD                     | 2           | —           | —         | —                   | —      | 保険                     |
| ALLSTATE CORP                 | 1           | 7           | 85        | 12,220              | 12,220 | 保険                     |
| AMGEN                         | 2           | 16          | 381       | 54,747              | 54,747 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AMERICAN EXPRESS              | 3           | 19          | 325       | 46,641              | 46,641 | 金融サービス                 |
| AFLAC                         | 3           | 17          | 118       | 16,994              | 16,994 | 保険                     |
| AMERICAN INT'L GROUP          | 4           | —           | —         | —                   | —      | 保険                     |
| AMERCO                        | 0.04        | —           | —         | —                   | —      | 運輸                     |
| VALERO ENERGY CORP            | 1           | 11          | 130       | 18,733              | 18,733 | エネルギー                  |
| COMCAST CORP-CL A             | —           | 130         | 521       | 74,811              | 74,811 | メディア・娯楽                |
| ANSYS INC                     | 0.41        | 2           | 80        | 11,600              | 11,600 | ソフトウェア・サービス            |
| APPLIED MATERIALS             | 4           | 25          | 353       | 50,686              | 50,686 | 半導体・半導体製造装置            |
| AUTODESK INC                  | 1           | 6           | 126       | 18,144              | 18,144 | ソフトウェア・サービス            |
| AUTOMATIC DATA PROCESS        | 2           | 13          | 281       | 40,439              | 40,439 | 商業・専門サービス              |
| AUTOZONE INC                  | —           | 0.57        | 138       | 19,823              | 19,823 | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| AVERY DENNISON CORP           | —           | 2           | 42        | 6,045               | 6,045  | 素材                     |
| BALL CORP                     | 1           | 9           | 52        | 7,479               | 7,479  | 素材                     |
| BANK NEW YORK CO              | 3           | 25          | 109       | 15,767              | 15,767 | 金融サービス                 |
| BAXTER INTERNATIONAL          | 2           | —           | —         | —                   | —      | ヘルスケア機器・サービス           |
| VERIZON COMMUNICATIONS        | 21          | 130         | 464       | 66,580              | 66,580 | 電気通信サービス               |
| BEST BUY COMPANY INC          | 1           | 5           | 46        | 6,733               | 6,733  | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| YUM BRANDS INC                | —           | 8           | 117       | 16,849              | 16,849 | 消費者サービス                |
| ROBERT HALF INTL INC          | 0.55        | 3           | 26        | 3,734               | 3,734  | 商業・専門サービス              |
| BORGWARNER INC                | 1           | 7           | 35        | 5,081               | 5,081  | 自動車・自動車部品              |
| C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC  | 0.65        | 3           | 33        | 4,854               | 4,854  | 運輸                     |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 0.55        | 4           | 66        | 9,586               | 9,586  | メディア・娯楽                |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL  | 0.11        | 0.65        | 83        | 12,015              | 12,015 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO       | 10          | 64          | 418       | 60,017              | 60,017 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ONEOK INC                     | 2           | 12          | 74        | 10,711              | 10,711 | エネルギー                  |
| UNITED RENTALS INC            | 0.34        | 2           | 84        | 12,069              | 12,069 | 資本財                    |
| SEMPRA ENERGY                 | 1           | 9           | 138       | 19,884              | 19,884 | 公益事業                   |
| QUANTA SERVICES INC           | 0.75        | 4           | 78        | 11,192              | 11,192 | 資本財                    |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC        | 5           | 19          | 7         | 1,056               | 1,056  | メディア・娯楽                |
| CSX CORP                      | 10          | 62          | 204       | 29,333              | 29,333 | 運輸                     |
| CAMPBELL SOUP CO (US)         | 0.96        | 6           | 28        | 4,075               | 4,075  | 食品・飲料・タバコ              |
| CARDINAL HEALTH               | 1           | —           | —         | —                   | —      | ヘルスケア機器・サービス           |
| CATERPILLAR                   | 2           | 16          | 381       | 54,799              | 54,799 | 資本財                    |
| CITRIX SYSTEMS INC            | 0.59        | —           | —         | —                   | —      | ソフトウェア・サービス            |
| LUMEN TECHNOLOGIES INC        | 7           | —           | —         | —                   | —      | 電気通信サービス               |

| 銘柄                           | 当 期 首 (前期末) |             | 当 期 末     |                     | 業 種                    |
|------------------------------|-------------|-------------|-----------|---------------------|------------------------|
|                              | 株 数<br>(百株) | 株 数<br>(百株) | 評 価 額     |                     |                        |
|                              |             |             | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額<br>(千円) |                        |
| CHURCH & DWIGHT CO INC       | —           | 7           | 73        | 10,521              | 家庭用品・パーソナル用品           |
| THE CIGNA GROUP              | 1           | 9           | 249       | 35,849              | ヘルスケア機器・サービス           |
| CINTAS CORP                  | —           | 2           | 136       | 19,596              | 商業・専門サービス              |
| CISCO SYSTEMS                | 20          | —           | —         | —                   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| CLOROX COMPANY               | 0.6         | 3           | 56        | 8,043               | 家庭用品・パーソナル用品           |
| COCA-COLA CO                 | 20          | 127         | 777       | 111,587             | 食品・飲料・タバコ              |
| COPART INC                   | 1           | —           | —         | —                   | 商業・専門サービス              |
| COGNEX CORP                  | 0.85        | —           | —         | —                   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         | 3           | 24          | 187       | 26,964              | 家庭用品・パーソナル用品           |
| MOLINA HEALTHCARE INC        | —           | 1           | 51        | 7,395               | ヘルスケア機器・サービス           |
| CONAGRA BRANDS INC           | 2           | 14          | 47        | 6,848               | 食品・飲料・タバコ              |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 1           | 10          | 92        | 13,319              | 公益事業                   |
| CMS ENERGY CORP              | —           | 9           | 52        | 7,583               | 公益事業                   |
| THE COOPER COS INC           | —           | 1           | 55        | 8,023               | ヘルスケア機器・サービス           |
| CUMMINS INC                  | 0.7         | 4           | 104       | 15,014              | 資本財                    |
| DARLING INGREDIENTS INC      | —           | 5           | 29        | 4,221               | 食品・飲料・タバコ              |
| DANAHER CORP                 | —           | 21          | 509       | 73,171              | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MOODY'S CORP                 | 0.8         | 5           | 169       | 24,343              | 金融サービス                 |
| TARGET (DAYTON HUDSON)       | 2           | 13          | 183       | 26,388              | 生活必需品流通・小売り            |
| DEERE&CO                     | 1           | —           | —         | —                   | 資本財                    |
| MORGAN STANLEY               | 6           | 38          | 322       | 46,268              | 金融サービス                 |
| REPUBLIC SERVICES INC        | 1           | —           | —         | —                   | 商業・専門サービス              |
| DECKERS OUTDOOR CORP         | —           | 0.81        | 40        | 5,882               | 耐久消費財・アパレル             |
| THE WALT DISNEY CO           | 9           | 56          | 497       | 71,399              | メディア・娯楽                |
| DOVER CORP                   | 0.69        | 4           | 59        | 8,505               | 資本財                    |
| OMNICOM GROUP                | —           | 6           | 58        | 8,329               | メディア・娯楽                |
| EBAY                         | 3           | 16          | 70        | 10,112              | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| EATON CORP                   | 1           | 12          | 238       | 34,209              | 資本財                    |
| CADENCE DESIGN SYSTEMS       | 1           | 8           | 191       | 27,546              | ソフトウェア・サービス            |
| ECOLAB INC                   | 1           | 8           | 144       | 20,705              | 素材                     |
| ELECTRONIC ARTS INC          | 1           | 8           | 101       | 14,503              | メディア・娯楽                |
| SALESFORCE INC               | 4           | 30          | 649       | 93,210              | ソフトウェア・サービス            |
| EMERSON ELECTRIC CO          | —           | 17          | 153       | 21,977              | 資本財                    |
| ATMOS ENERGY CORP            | 0.62        | 4           | 46        | 6,682               | 公益事業                   |
| ESTEE LAUDER CO-CL A         | 1           | —           | —         | —                   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| EXPEDITORS INTL WASH INC     | 0.81        | 4           | 56        | 8,046               | 運輸                     |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 0.18        | 1           | 44        | 6,445               | 金融サービス                 |
| FAIR ISAAC CORP              | —           | 0.78        | 60        | 8,685               | ソフトウェア・サービス            |
| ASSURANT INC                 | 0.28        | 1           | 16        | 2,327               | 保険                     |
| FASTENAL CO                  | 2           | 16          | 94        | 13,591              | 資本財                    |
| FISERV INC                   | —           | 19          | 232       | 33,316              | 金融サービス                 |
| FRANKLIN RESOURCES INC       | 1           | 10          | 26        | 3,776               | 金融サービス                 |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO      | 1           | —           | —         | —                   | 保険                     |
| DENTSPLY SIRONA INC          | 1           | 8           | 33        | 4,848               | ヘルスケア機器・サービス           |
| GENERAL MILLS INC            | 2           | 18          | 154       | 22,100              | 食品・飲料・タバコ              |
| GENUINE PARTS CO             | 0.69        | 4           | 65        | 9,393               | 一般消費財・サービス流通・小売り       |

| 銘柄                          | 当期首(前期末)    | 当 期 末       |           |                     | 業 種                    |
|-----------------------------|-------------|-------------|-----------|---------------------|------------------------|
|                             | 株 数<br>(百株) | 株 数<br>(百株) | 価 額       |                     |                        |
|                             |             |             | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額<br>(千円) |                        |
| GILEAD SCIENCES INC         | 5           | 38          | 296       | 42,563              | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GARTNER INC                 | —           | 2           | 82        | 11,840              | ソフトウェア・サービス            |
| NVIDIA CORP                 | 12          | 76          | 3,223     | 462,479             | 半導体・半導体製造装置            |
| GRACO INC                   | —           | 5           | 43        | 6,222               | 資本財                    |
| GRAINGER (WW) INC           | 0.21        | 1           | 98        | 14,082              | 資本財                    |
| HALLIBURTON CO              | 4           | 26          | 80        | 11,564              | エネルギー                  |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC   | —           | 5           | 112       | 16,163              | 資本財                    |
| HASBRO INC                  | 0.63        | 4           | 27        | 3,891               | 耐久消費財・アパレル             |
| HP INC                      | 5           | 27          | 81        | 11,675              | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| HOLOGIC INC                 | 1           | 7           | 59        | 8,509               | ヘルスケア機器・サービス           |
| HOME DEPOT                  | 5           | 31          | 941       | 135,144             | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 0.87        | —           | —         | —                   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| HORMEL FOODS CORP           | 1           | 8           | 35        | 5,098               | 食品・飲料・タバコ              |
| LENNOX INTERNATIONAL INC    | 0.16        | 1           | 33        | 4,830               | 資本財                    |
| HUMANA INC                  | 0.61        | 3           | 168       | 24,187              | ヘルスケア機器・サービス           |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC | 0.45        | 2           | 42        | 6,158               | 運輸                     |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC   | 7           | 41          | 42        | 6,128               | 銀行                     |
| BIOGEN INC                  | 0.72        | 4           | 132       | 19,065              | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| IDEX CORP                   | 0.36        | 2           | 45        | 6,467               | 資本財                    |
| ILLINOIS TOOL WORKS         | 1           | 9           | 231       | 33,161              | 資本財                    |
| INTUIT INC                  | 1           | 8           | 392       | 56,317              | ソフトウェア・サービス            |
| IDEXX LABORATORIES INC      | 0.41        | 2           | 132       | 18,967              | ヘルスケア機器・サービス           |
| INTEL CORP                  | 20          | 129         | 426       | 61,211              | 半導体・半導体製造装置            |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES   | 1           | 7           | 55        | 7,971               | 素材                     |
| INT'L PAPER CO              | 1           | 10          | 32        | 4,684               | 素材                     |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS    | 1           | 11          | 44        | 6,404               | メディア・娯楽                |
| JOHNSON & JOHNSON           | 13          | 80          | 1,329     | 190,741             | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS     | 1           | 9           | 67        | 9,646               | 保険                     |
| KELLOGG CO                  | 1           | 9           | 61        | 8,807               | 食品・飲料・タバコ              |
| KEY CORP                    | 4           | —           | —         | —                   | 銀行                     |
| KIMBERLY-CLARK CORP         | 1           | 10          | 145       | 20,813              | 家庭用品・パーソナル用品           |
| BLACKROCK INC               | 0.73        | 4           | 308       | 44,327              | 金融サービス                 |
| KROGER CO                   | 3           | 19          | 92        | 13,228              | 生活必需品流通・小売り            |
| LAM RESEARCH CORP           | 0.68        | 4           | 256       | 36,862              | 半導体・半導体製造装置            |
| AKAMAI TECHNOLOGIES, INC    | —           | 4           | 42        | 6,142               | ソフトウェア・サービス            |
| PLUG POWER INC              | 2           | —           | —         | —                   | 資本財                    |
| ELI LILLY & CO              | 4           | 24          | 1,145     | 164,399             | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| LINCOLN NATIONAL CORP       | 0.88        | —           | —         | —                   | 保険                     |
| UNITED PARCEL SERVICE B     | 3           | 22          | 376       | 53,975              | 運輸                     |
| AGILENT TECHNOLOGIES        | 1           | 9           | 115       | 16,638              | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| LOEWS CORP                  | 1           | —           | —         | —                   | 保険                     |
| LOWES COMPANIES             | 3           | 18          | 393       | 56,483              | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 1           | 7           | 68        | 9,797               | 食品・飲料・タバコ              |
| MCDONALD'S CORP             | 3           | 22          | 654       | 93,930              | 消費者サービス                |
| S&P GLOBAL INC              | 1           | 10          | 403       | 57,861              | 金融サービス                 |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP   | 2           | 19          | 174       | 25,031              | ヘルスケア機器・サービス           |

| 銘柄                                     | 当期首(前期末)    | 当 期 末       |           |                     | 業 種                    |
|--|-------------|-------------|-----------|---------------------|------------------------|
|  | 株 数<br>(百株) | 株 数<br>(百株) | 評 価 額     |                     |                        |
|  |             |             | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額<br>(千円) |                        |
| MARSH & MCLENNAN COS                   | 2           | 15          | 287       | 41,206              | 保険                     |
| MASCO CORP                             | 1           | 6           | 38        | 5,510               | 資本財                    |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS              | 0.34        | 1           | 80        | 11,489              | 素材                     |
| MERCK & CO                             | 12          | 78          | 899       | 129,019             | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| LABORATORY CRP OF AMER                 | 0.46        | 2           | 63        | 9,064               | ヘルスケア機器・サービス           |
| MICROSOFT CORP                         | 35          | 218         | 7,324     | 1,050,998           | ソフトウェア・サービス            |
| 3 M COMPANY                            | 2           | 16          | 165       | 23,802              | 資本財                    |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC                 | 0.8         | —           | —         | —                   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| ILLUMINA INC                           | 0.94        | 4           | 97        | 13,976              | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NETAPP INC                             | —           | 6           | 48        | 6,943               | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| NEWELL BRANDS INC                      | 1           | —           | —         | —                   | 耐久消費財・アパレル             |
| NEWMONT CORPORATION                    | 3           | 25          | 105       | 15,154              | 素材                     |
| NVR INC                                | —           | 0.1         | 61        | 8,839               | 耐久消費財・アパレル             |
| NIKE B                                 | 6           | 38          | 418       | 60,078              | 耐久消費財・アパレル             |
| NORFOLK SOUTHERN CORP                  | 1           | 6           | 149       | 21,427              | 運輸                     |
| EVERSOURCE ENERGY                      | 1           | 11          | 83        | 11,926              | 公益事業                   |
| NORTHERN TRUST CORP                    | 0.95        | 5           | 41        | 5,901               | 金融サービス                 |
| NUCOR CORP                             | 1           | 7           | 118       | 16,947              | 素材                     |
| CHENIERE ENERGY INC                    | 1           | 7           | 112       | 16,200              | エネルギー                  |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE              | 0.5         | 3           | 106       | 15,279              | 運輸                     |
| EXELON CORP                            | —           | 31          | 123       | 17,734              | 公益事業                   |
| PAYCHEX INC                            | —           | 10          | 108       | 15,598              | 商業・専門サービス              |
| ALIGN TECHNOLOGY INC                   | 0.35        | 2           | 71        | 10,286              | ヘルスケア機器・サービス           |
| PEPSICO INC                            | 6           | 42          | 792       | 113,685             | 食品・飲料・タバコ              |
| PENTAIR PLC                            | 0.8         | 5           | 34        | 4,943               | 資本財                    |
| ESSENTIAL UTILITIES INC                | 1           | 7           | 30        | 4,403               | 公益事業                   |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP           | 2           | 11          | 146       | 20,954              | 銀行                     |
| PPG INDUSTRIES INC                     | 1           | 7           | 108       | 15,604              | 素材                     |
| PRICE T ROWE GROUP INC                 | 1           | 6           | 70        | 10,054              | 金融サービス                 |
| QUEST DIAGNOSTICS                      | 0.64        | 3           | 48        | 6,963               | ヘルスケア機器・サービス           |
| PROCTER & GAMBLE CO                    | 12          | 72          | 1,083     | 155,444             | 家庭用品・パーソナル用品           |
| PROGRESSIVE CORP                       | 2           | 18          | 244       | 35,111              | 保険                     |
| PULTE GROUP INC                        | —           | 6           | 52        | 7,584               | 耐久消費財・アパレル             |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC            | 0.88        | 6           | 67        | 9,692               | 金融サービス                 |
| REPLIGEN CORP                          | —           | 1           | 24        | 3,498               | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| RESMED INC                             | 0.69        | —           | —         | —                   | ヘルスケア機器・サービス           |
| US BANCORP                             | 6           | 47          | 151       | 21,760              | 銀行                     |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD                 | 1           | 10          | 79        | 11,366              | 保険                     |
| ROLLINS INC                            | 1           | —           | —         | —                   | 商業・専門サービス              |
| ROPER TECHNOLOGIES INC                 | 0.5         | —           | —         | —                   | ソフトウェア・サービス            |
| ROCKWELL AUTOMATION INC                | 0.55        | 3           | 105       | 15,103              | 資本財                    |
| ACCENTURE PLC-CL A                     | 3           | 19          | 582       | 83,587              | ソフトウェア・サービス            |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC               | 0.61        | 3           | 75        | 10,776              | 保険                     |
| TRAVELERS COS INC/THE                  | 1           | 6           | 120       | 17,224              | 保険                     |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES | —           | 18          | 96        | 13,866              | 金融サービス                 |
| BOOKING HOLDINGS INC                   | —           | 1           | 304       | 43,674              | 消費者サービス                |

| 銘柄                           | 当期首(前期末)    | 当 期 末       |           |                     | 業 種                    |
|------------------------------|-------------|-------------|-----------|---------------------|------------------------|
|                              | 株 数<br>(百株) | 株 数<br>(百株) | 価 額       |                     |                        |
|                              |             |             | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額<br>(千円) |                        |
| SCHLUMBERGER                 | 6           | 45          | 210       | 30,237              | エネルギー                  |
| SCHWAB (CHARLES) CORP        | 7           | 46          | 248       | 35,713              | 金融サービス                 |
| POOL CORP                    | 0.19        | 1           | 41        | 5,915               | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   | —           | 6           | 93        | 13,409              | ヘルスケア機器・サービス           |
| BUNGE LIMITED                | 0.68        | 4           | 41        | 6,004               | 食品・飲料・タバコ              |
| ELEVANCE HEALTH INC          | 1           | 7           | 327       | 47,049              | ヘルスケア機器・サービス           |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       | 0.74        | 5           | 100       | 14,460              | ヘルスケア機器・サービス           |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 1           | 7           | 53        | 7,625               | 保険                     |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE      | 1           | 7           | 185       | 26,585              | 素材                     |
| SVB FINANCIAL GROUP          | 0.34        | —           | —         | —                   | 銀行                     |
| SMITH (A. O.) CORP           | 0.75        | —           | —         | —                   | 資本財                    |
| SNAP-ON INC                  | 0.26        | —           | —         | —                   | 資本財                    |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 1           | 10          | 90        | 13,012              | 保険                     |
| ADVANCE AUTO PARTS           | 0.31        | 1           | 11        | 1,686               | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| EDISON INTL                  | 11          | 11          | 74        | 10,753              | 公益事業                   |
| TRUIST FINANCIAL CORP        | 6           | 40          | 121       | 17,468              | 銀行                     |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC       | 1           | 6           | 125       | 18,003              | 資本財                    |
| STATE STREET CORP            | 1           | 10          | 75        | 10,850              | 金融サービス                 |
| STEEL DYNAMICS INC           | 1           | 5           | 56        | 8,118               | 素材                     |
| GEN DIGITAL INC              | 3           | 17          | 31        | 4,467               | ソフトウェア・サービス            |
| SYNOPSIS INC                 | —           | 4           | 197       | 28,355              | ソフトウェア・サービス            |
| TELEFLEX INC                 | 0.22        | 1           | 37        | 5,448               | ヘルスケア機器・サービス           |
| TEXAS INSTRUMENTS            | 4           | 28          | 474       | 68,139              | 半導体・半導体製造装置            |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 1           | —           | —         | —                   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TORO CO                      | —           | 3           | 31        | 4,500               | 資本財                    |
| DAVITA INC                   | 0.34        | 1           | 13        | 1,935               | ヘルスケア機器・サービス           |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY       | 0.56        | 3           | 70        | 10,167              | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| TRIMBLE IMS HOLDINGS         | 1           | 7           | 36        | 5,211               | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| UGI CORP                     | 1           | 7           | 18        | 2,702               | 公益事業                   |
| UNION PACIFIC CORP           | 3           | 19          | 381       | 54,783              | 運輸                     |
| VF CORP                      | 1           | 11          | 20        | 2,885               | 耐久消費財・アパレル             |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC   | 1           | —           | —         | —                   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WASTE MANAGEMENT INC         | —           | 12          | 208       | 29,890              | 商業・専門サービス              |
| WATERS CORP                  | 0.29        | 1           | 45        | 6,524               | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WEBSTER FINANCIAL CORP       | 1           | 4           | 15        | 2,273               | 銀行                     |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 0.35        | 2           | 78        | 11,322              | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JM SMUCKER CO                | —           | 3           | 49        | 7,117               | 食品・飲料・タバコ              |
| VAIL RESORTS INC             | 0.19        | 1           | 35        | 5,034               | 消費者サービス                |
| WESTERN DIGITAL CORP         | —           | 9           | 37        | 5,361               | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| WEYERHAEUSER CO              | 3           | 21          | 65        | 9,425               | エクイティ不動産投資信託(REIT)     |
| WHIRLPOOL CORP               | —           | 1           | 23        | 3,409               | 耐久消費財・アパレル             |
| NASDAQ INC                   | 0.55        | 10          | 49        | 7,158               | 金融サービス                 |
| CME GROUP INC                | 1           | —           | —         | —                   | 金融サービス                 |
| WILLIAMS COS                 | 5           | 38          | 118       | 16,995              | エネルギー                  |
| LQ CORP                      | 1           | 7           | 42        | 6,145               | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| CARMAX INC                   | 0.78        | 5           | 46        | 6,729               | 一般消費財・サービス流通・小売り       |

| 銘柄                                 | 当期首(前期末)    | 当 期 末       |           |                     | 業 種                    |
|------------------------------------|-------------|-------------|-----------|---------------------|------------------------|
|                                    | 株 数<br>(百株) | 株 数<br>(百株) | 評 価 額     |                     |                        |
|                                    |             |             | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額<br>(千円) |                        |
| TJX COMPANIES INC                  | 5           | 35          | 288       | 41,329              | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A       | 0.25        | —           | —         | —                   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| CBRE GROUP INC-A                   | 1           | 9           | 71        | 10,233              | 不動産管理・開発               |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A               | —           | 5           | 9         | 1,309               | 電気通信サービス               |
| REGIONS FINL CORP                  | 4           | 27          | 46        | 6,605               | 銀行                     |
| MOSAIC CO/THE                      | 1           | —           | —         | —                   | 素材                     |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC           | 0.18        | 1           | 30        | 4,377               | 金融サービス                 |
| CELANESE CORP-SERIES A             | 0.61        | —           | —         | —                   | 素材                     |
| DEXCOM INC                         | 1           | 12          | 158       | 22,770              | ヘルスケア機器・サービス           |
| BUILDERS FIRSTSOURCE INC           | —           | 4           | 54        | 7,813               | 資本財                    |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC           | 0.56        | 3           | 100       | 14,420              | 金融サービス                 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-C               | —           | 7           | 13        | 1,993               | 電気通信サービス               |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC      | 2           | 17          | 189       | 27,257              | 金融サービス                 |
| MASTERCARD INC-CLASS A             | 4           | 26          | 999       | 143,386             | 金融サービス                 |
| WESTERN UNION CO                   | 2           | —           | —         | —                   | ソフトウェア・サービス            |
| OWENS CORNING                      | 0.51        | 3           | 43        | 6,212               | 資本財                    |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC | —           | 3           | 57        | 8,252               | 商業・専門サービス              |
| AECOM                              | —           | 4           | 34        | 4,975               | 資本財                    |
| DELTA AIR LINES INC                | 0.78        | 4           | 19        | 2,810               | 運輸                     |
| INSULET CORP                       | 0.31        | 2           | 58        | 8,343               | ヘルスケア機器・サービス           |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES        | 1           | 7           | 89        | 12,901              | 金融サービス                 |
| LULULEMON ATHLETICA INC            | 0.59        | 3           | 136       | 19,654              | 耐久消費財・アパレル             |
| VMWARE INC-CLASS A                 | 1           | 7           | 100       | 14,417              | ソフトウェア・サービス            |
| MERCADOLIBRE INC                   | 0.21        | 1           | 171       | 24,638              | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| ULTA BEAUTY INC                    | 0.3         | 1           | 68        | 9,759               | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| INVESCO LTD                        | 1           | 8           | 13        | 1,913               | 金融サービス                 |
| VISA INC-CLASS A SHARES            | 8           | 50          | 1,153     | 165,481             | 金融サービス                 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC        | 0.87        | 6           | 91        | 13,113              | 公益事業                   |
| MARATHON PETROLEUM CORP            | 3           | 14          | 157       | 22,651              | エネルギー                  |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 0.67        | 4           | 29        | 4,246               | 資本財                    |
| KINDER MORGAN INC                  | 10          | 67          | 110       | 15,797              | エネルギー                  |
| XYLEM INC                          | 0.86        | 7           | 80        | 11,534              | 資本財                    |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A           | —           | 8           | 75        | 10,773              | 素材                     |
| SPLUNK INC                         | 0.9         | 4           | 49        | 7,114               | ソフトウェア・サービス            |
| HCA HEALTHCARE INC                 | 1           | 6           | 188       | 27,000              | ヘルスケア機器・サービス           |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC           | 0.29        | 2           | 25        | 3,601               | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA             | 0.83        | —           | —         | —                   | 銀行                     |
| NXP SEMICONDUCTORS NV              | 1           | 8           | 158       | 22,688              | 半導体・半導体製造装置            |
| TARGA RESOURCES CORP               | 1           | 6           | 44        | 6,360               | エネルギー                  |
| LEAR CORP                          | 0.38        | 2           | 27        | 4,011               | 自動車・自動車部品              |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC            | 0.52        | 3           | 43        | 6,291               | 金融サービス                 |
| TESLA INC                          | 4           | 88          | 2,262     | 324,711             | 自動車・自動車部品              |
| GENERAC HOLDINGS INC               | 0.3         | 2           | 26        | 3,796               | 資本財                    |
| ALLY FINANCIAL INC                 | 1           | 10          | 28        | 4,033               | 金融サービス                 |
| LPL FINANCIAL HOLDINGS INC         | 0.6         | 2           | 48        | 6,932               | 金融サービス                 |
| APTIV PLC                          | 1           | 9           | 91        | 13,081              | 自動車・自動車部品              |

| 銘柄                           | 当期首(前期末)    | 期 末         |           |                     | 業 種                    |
|------------------------------|-------------|-------------|-----------|---------------------|------------------------|
|                              | 株 数<br>(百株) | 株 数<br>(百株) | 評 価 額     |                     |                        |
|                              |             |             | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額<br>(千円) |                        |
| PHILLIPS 66                  | 2           | 13          | 125       | 18,043              | エネルギー                  |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC       | 0.54        | —           | —         | —                   | ソフトウェア・サービス            |
| SERVICENOW INC               | 1           | 6           | 346       | 49,786              | ソフトウェア・サービス            |
| WORKDAY INC-CLASS A          | —           | 6           | 140       | 20,123              | ソフトウェア・サービス            |
| PTC INC                      | —           | 3           | 48        | 7,013               | ソフトウェア・サービス            |
| ZOETIS INC                   | 2           | 14          | 238       | 34,209              | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| KEURIG DR PEPPER INC         | 4           | 28          | 88        | 12,643              | 食品・飲料・タバコ              |
| TWILIO INC - A               | —           | 5           | 35        | 5,044               | ソフトウェア・サービス            |
| SNAP INC - A                 | —           | 30          | 33        | 4,777               | メディア・娯楽                |
| BLACK KNIGHT INC             | —           | 4           | 27        | 3,966               | ソフトウェア・サービス            |
| BAKER HUGHES CO              | 5           | 32          | 95        | 13,767              | エネルギー                  |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC     | —           | 4           | 51        | 7,405               | 食品・飲料・タバコ              |
| AXON ENTERPRISE INC          | —           | 2           | 40        | 5,794               | 資本財                    |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION  | 0.9         | 5           | 28        | 4,091               | 運輸                     |
| BURLINGTON STORES INC        | 0.31        | 2           | 33        | 4,783               | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC     | 3           | —           | —         | —                   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALLEGION PLC                 | 0.44        | 2           | 32        | 4,690               | 資本財                    |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC     | —           | 4           | 28        | 4,124               | 商業・専門サービス              |
| STERIS PLC                   | 0.48        | 2           | 61        | 8,832               | ヘルスケア機器・サービス           |
| DOCUSIGN INC                 | —           | 6           | 31        | 4,484               | ソフトウェア・サービス            |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 1           | 8           | 109       | 15,778              | 消費者サービス                |
| ARAMARK                      | —           | 7           | 28        | 4,087               | 消費者サービス                |
| AMCOR PLC                    | 7           | 43          | 43        | 6,208               | 素材                     |
| FOX CORP - CLASS A           | —           | 9           | 29        | 4,303               | メディア・娯楽                |
| FOX CORP- CLASS B            | —           | 4           | 15        | 2,162               | メディア・娯楽                |
| CLARIVATE PLC                | —           | 12          | 10        | 1,515               | 商業・専門サービス              |
| AVANTOR INC                  | —           | 20          | 41        | 5,890               | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CARRIER GLOBAL CORP          | 4           | 24          | 117       | 16,892              | 資本財                    |
| OTIS WORLDWIDE CORP          | 2           | 12          | 105       | 15,144              | 資本財                    |
| FERGUSON PLC                 | —           | 6           | 95        | 13,702              | 資本財                    |
| PAYLOCITY HOLDING CORP       | —           | 1           | 22        | 3,271               | 商業・専門サービス              |
| CARLYLE GROUP INC/THE        | 0.78        | —           | —         | —                   | 金融サービス                 |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS  | —           | 5           | 34        | 4,976               | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| INGERSOLL-RAND INC           | 2           | 11          | 74        | 10,738              | 資本財                    |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A      | 1           | 19          | 26        | 3,861               | 自動車・自動車部品              |
| WARNER BROS DISCOVERY INC    | 10          | —           | —         | —                   | メディア・娯楽                |
| ZENDESK INC                  | 0.68        | —           | —         | —                   | ソフトウェア・サービス            |
| ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC    | 2           | 7           | 18        | 2,657               | メディア・娯楽                |
| HF SINCLAIR CORP             | —           | 5           | 21        | 3,079               | エネルギー                  |
| MARVELL TECHNOLOGY INC       | —           | 26          | 153       | 21,977              | 半導体・半導体製造装置            |
| LINDE PLC                    | —           | 15          | 556       | 79,923              | 素材                     |
| GRAB HOLDINGS LTD - CL A     | 7           | —           | —         | —                   | 運輸                     |
| CATALENT INC                 | 0.82        | —           | —         | —                   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SYNCHRONY FINANCIAL          | 3           | 14          | 47        | 6,869               | 金融サービス                 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP     | 1           | 14          | 36        | 5,273               | 銀行                     |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC    | 0.89        | 5           | 83        | 11,923              | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |



| 銘柄                             | 当期首(前期末)                   | 当 期 末       |           |                     | 業 種                    |  |
|--------------------------------|----------------------------|-------------|-----------|---------------------|------------------------|--|
|                                | 株 数<br>(百株)                | 株 数<br>(百株) | 評 価 額     |                     |                        |  |
|                                |                            |             | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額<br>(千円) |                        |  |
| HUBSPOT INC                    | 0.25                       | 1           | 68        | 9,775               | ソフトウェア・サービス            |  |
| BIO-TECHNE CORP                | 0.18                       | 4           | 35        | 5,057               | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| KORNIT DIGITAL LTD             | 0.24                       | —           | —         | —                   | 資本財                    |  |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL | 3                          | 22          | 144       | 20,795              | 資本財                    |  |
| TRANSUNION                     | —                          | 5           | 44        | 6,357               | 商業・専門サービス              |  |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE   | 1                          | 7           | 45        | 6,588               | 食品・飲料・タバコ              |  |
| TELADOC HEALTH INC             | 0.65                       | —           | —         | —                   | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| WESTROCK CO                    | 1                          | 9           | 26        | 3,782               | 素材                     |  |
| NOVOCURE LTD                   | 0.44                       | —           | —         | —                   | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| FORTIVE CORP                   | 1                          | 12          | 85        | 12,281              | 資本財                    |  |
| ALPHABET INC-CL A              | 1                          | 184         | 2,252     | 323,249             | メディア・娯楽                |  |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRIS      | 6                          | 37          | 62        | 8,993               | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| EQUITABLE HOLDINGS INC         | 1                          | 11          | 28        | 4,112               | 金融サービス                 |  |
| ALPHABET INC-CL C              | 1                          | 166         | 2,047     | 293,749             | メディア・娯楽                |  |
| ZSCALER INC                    | —                          | 2           | 38        | 5,508               | ソフトウェア・サービス            |  |
| CABLE ONE INC                  | 0.03                       | —           | —         | —                   | メディア・娯楽                |  |
| LINDE PLC                      | 2                          | —           | —         | —                   | 素材                     |  |
| 小 計                            | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 > | 703         | 4,673     | 58,929              | 8,455,774              |  |
| (カナダ)                          |                            | 271         | 286       | —                   | <70.8%>                |  |
| AGNICO EAGLE MINES             | 2                          | 15          | 102       | 11,216              | 素材                     |  |
| BANK MONTREAL                  | 3                          | 22          | 260       | 28,349              | 銀行                     |  |
| BANK NOVA SCOTIA               | 5                          | 35          | 226       | 24,730              | 銀行                     |  |
| NATIONAL BANK OF CANADA        | 1                          | 9           | 92        | 10,061              | 銀行                     |  |
| BROOKFIELD CORP                | 7                          | 43          | 180       | 19,645              | 金融サービス                 |  |
| CAE INC                        | 1                          | 11          | 32        | 3,560               | 資本財                    |  |
| CAMECO CORP                    | 1                          | 12          | 50        | 5,501               | エネルギー                  |  |
| ROGERS COMMUNICATIONS -CL B    | 1                          | 10          | 60        | 6,630               | 電気通信サービス               |  |
| CANADIAN TIRE CORP -CL A       | 0.27                       | 1           | 24        | 2,656               | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO       | 2                          | 17          | 271       | 29,546              | 運輸                     |  |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC          | 0.97                       | 5           | 21        | 2,378               | 耐久消費財・アパレル             |  |
| OPEN TEXT CORP                 | 1                          | 6           | 36        | 3,939               | ソフトウェア・サービス            |  |
| RB GLOBAL INC                  | 0.54                       | 5           | 41        | 4,537               | 商業・専門サービス              |  |
| FORTIS INC                     | 2                          | 13          | 76        | 8,388               | 公益事業                   |  |
| TELUS CORP                     | 2                          | 17          | 43        | 4,695               | 電気通信サービス               |  |
| ENBRIDGE                       | 9                          | 62          | 296       | 32,315              | エネルギー                  |  |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC   | 4                          | 23          | 151       | 16,529              | 生活必需品流通・小売り            |  |
| MAGNA INTERNATIONAL INC        | 1                          | 8           | 56        | 6,131               | 自動車・自動車部品              |  |
| SUN LIFE FINANCIAL INC         | —                          | 18          | 120       | 13,122              | 保険                     |  |
| METRO INC                      | 1                          | 7           | 50        | 5,523               | 生活必需品流通・小売り            |  |
| POWER CORP OF CANADA           | 4                          | —           | —         | —                   | 保険                     |  |
| LUNDIN MINING CORP             | 3                          | 17          | 18        | 1,983               | 素材                     |  |
| THOMSON REUTERS CORP           | 0.83                       | 4           | 87        | 9,520               | 商業・専門サービス              |  |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD        | 0.4                        | 3           | 32        | 3,534               | 資本財                    |  |
| TORONTO-DOMINION BANK          | 9                          | 57          | 449       | 48,957              | 銀行                     |  |
| WEST FRASER TIMBER CO LTD      | —                          | 2           | 25        | 2,821               | 素材                     |  |

| 銘柄                           | 当期末(前期末)    |             | 期 末       |                     | 業 種                    |
|------------------------------|-------------|-------------|-----------|---------------------|------------------------|
|                              | 株 数<br>(百株) | 株 数<br>(百株) | 価 額       |                     |                        |
|                              |             |             | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額<br>(千円) |                        |
| KINROSS GOLD CORP            | 6           | 33          | 20        | 2,239               | 素材                     |
| INTACT FINANCIAL CORP        | 1           | 5           | 99        | 10,854              | 保険                     |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 2           | 13          | 74        | 8,096               | 素材                     |
| KEYERA CORP                  | 1           | 5           | 16        | 1,833               | エネルギー                  |
| PARKLAND CORP                | 0.74        | 4           | 13        | 1,455               | エネルギー                  |
| PEMBINA PIPELINE CORP        | 2           | 16          | 63        | 6,943               | エネルギー                  |
| DOLLARAMA INC                | —           | 10          | 88        | 9,662               | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES  | —           | 21          | 22        | 2,442               | 公益事業                   |
| NORTHLAND POWER INC          | 1           | —           | —         | —                   | 公益事業                   |
| IVANHOE MINES LTD-CL A       | 4           | 15          | 19        | 2,144               | 素材                     |
| NUTRIEN LTD                  | 2           | 15          | 119       | 12,987              | 素材                     |
| FIRSTSERVICE CORP            | 0.19        | 1           | 19        | 2,153               | 不動産管理・開発               |
| BROOKFIELD RENEWABLE COR-A   | —           | 4           | 17        | 1,857               | 公益事業                   |
| SHOPIFY INC - CLASS A        | 0.55        | 37          | 318       | 34,657              | ソフトウェア・サービス            |
| HYDRO ONE LTD                | 1           | 11          | 41        | 4,567               | 公益事業                   |
| 小 計                          | 94          | 630         | 3,746     | 408,172             |                        |
| 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数 < 比 率 >   | 36          | 39          | —         | <3.4%>              |                        |
| (ドイツ)                        |             |             | 千ユーロ      |                     |                        |
| ADIDAS AG                    | 0.9         | 5           | 88        | 13,894              | 耐久消費財・アパレル             |
| COMMERZBANK AG               | 4           | 27          | 26        | 4,111               | 銀行                     |
| GEA GROUP AG                 | 1           | 3           | 15        | 2,362               | 資本財                    |
| DEUTSCHE POST AG-REG         | —           | 31          | 134       | 21,032              | 運輸                     |
| MERCK KGAA                   | 0.61        | 3           | 57        | 8,975               | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SAP SE                       | 5           | —           | —         | —                   | ソフトウェア・サービス            |
| HENKEL AG & CO KGAA          | 0.5         | 3           | 24        | 3,786               | 家庭用品・パーソナル用品           |
| PUMA SE                      | 0.51        | 2           | 14        | 2,241               | 耐久消費財・アパレル             |
| HENKEL AG & CO KGAA -PFD     | 0.85        | 5           | 37        | 5,914               | 家庭用品・パーソナル用品           |
| BEIERSDORF AG                | 0.48        | 3           | 42        | 6,699               | 家庭用品・パーソナル用品           |
| HEIDELBERG MATERIALS AG      | 0.71        | 3           | 27        | 4,311               | 素材                     |
| ALLIANZ SE-REG               | 1           | —           | —         | —                   | 保険                     |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG       | —           | 20          | 18        | 2,882               | 運輸                     |
| MUENCHENER RUECKVERSICH.     | —           | 4           | 143       | 22,400              | 保険                     |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG  | 1           | 10          | 118       | 18,475              | 自動車・自動車部品              |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD | 0.28        | 1           | 16        | 2,513               | 自動車・自動車部品              |
| CARL ZEISS MEDITEC AG - BR   | 0.29        | —           | —         | —                   | ヘルスケア機器・サービス           |
| DEUTSCHE BOERSE              | 0.9         | 5           | 91        | 14,380              | 金融サービス                 |
| MTU AERO ENGINES AG          | 0.25        | —           | —         | —                   | 資本財                    |
| SYMRISE AG                   | 0.61        | 3           | 36        | 5,701               | 素材                     |
| BRENTAG SE                   | 0.74        | 5           | 37        | 5,920               | 資本財                    |
| EVONIK INDUSTRIES AG         | 1           | 6           | 10        | 1,713               | 素材                     |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 5           | 34          | 9         | 1,417               | 電気通信サービス               |
| LEG IMMOBILIEN SE            | 0.4         | 3           | 15        | 2,491               | 不動産管理・開発               |
| VONOVIA SE                   | —           | 23          | 39        | 6,233               | 不動産管理・開発               |
| KNORR-BREMSE AG              | —           | 2           | 14        | 2,292               | 資本財                    |
| ZALANDO SE                   | 1           | 8           | 22        | 3,494               | 一般消費財・サービス流通・小売り       |
| COVESTRO AG                  | —           | 6           | 29        | 4,600               | 素材                     |

| 銘柄                     | 当期首(前期末)    |             | 当 期 末     |                     |              | 業 種 |
|------------------------|-------------|-------------|-----------|---------------------|--------------|-----|
|                        | 株 数<br>(百株) | 株 数<br>(百株) | 評 価 額     |                     |              |     |
|                        |             |             | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額<br>(千円) |              |     |
| HELLOFRESH SE          | 1           | 5           | 10        | 1,666               | 生活必需品流通・小売り  |     |
| DELIVERY HERO SE       | 0.75        | —           | —         | —                   | 消費者サービス      |     |
| 国 小 計                  | 株 数 ・ 金 額   | 32          | 231       | 1,083               | 169,512      |     |
|                        | 銘柄数 <比率>    | 24          | 25        | —                   | <1.4%>       |     |
| (イタリア)                 |             |             |           |                     |              |     |
| ASSICURAZIONI GENERALI | —           | 31          | 57        | 8,951               | 保険           |     |
| INTESA SANPAOLO        | 77          | —           | —         | —                   | 銀行           |     |
| MEDIOBANCA             | —           | 18          | 19        | 3,079               | 銀行           |     |
| ENEL                   | 39          | 254         | 154       | 24,119              | 公益事業         |     |
| TERNA SPA              | —           | 46          | 35        | 5,582               | 公益事業         |     |
| AMPLIFON SPA           | 0.59        | —           | —         | —                   | ヘルスケア機器・サービス |     |
| PRYSMIAN SPA           | 1           | 6           | 23        | 3,644               | 資本財          |     |
| MONCLER SPA            | —           | 6           | 39        | 6,223               | 耐久消費財・アパレル   |     |
| NEXI SPA               | 3           | 14          | 10        | 1,569               | 金融サービス       |     |
| FINECOBANK SPA         | —           | 18          | 22        | 3,536               | 銀行           |     |
| POSTE ITALIANE SPA     | —           | 16          | 15        | 2,406               | 保険           |     |
| 国 小 計                  | 株 数 ・ 金 額   | 122         | 413       | 377                 | 59,114       |     |
|                        | 銘柄数 <比率>    | 5           | 9         | —                   | <0.5%>       |     |
| (フランス)                 |             |             |           |                     |              |     |
| BOUYGUES ORD           | 1           | 5           | 17        | 2,714               | 資本財          |     |
| AIR LIQUIDE            | 2           | —           | —         | —                   | 素材           |     |
| LOREAL                 | 1           | 7           | 303       | 47,440              | 家庭用品・パーソナル用品 |     |
| LVMH                   | —           | 8           | 708       | 110,929             | 耐久消費財・アパレル   |     |
| PUBLICIS GROUPE        | 1           | —           | —         | —                   | メディア・娯楽      |     |
| MICHELIN               | 3           | 19          | 52        | 8,144               | 自動車・自動車部品    |     |
| SEB SA                 | 0.13        | —           | —         | —                   | 耐久消費財・アパレル   |     |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE  | 2           | 16          | 264       | 41,438              | 資本財          |     |
| VIVENDI SE             | 3           | —           | —         | —                   | メディア・娯楽      |     |
| TOTALENERGIES SE       | 12          | 73          | 381       | 59,693              | エネルギー        |     |
| VALEO SA               | 1           | 6           | 12        | 1,960               | 自動車・自動車部品    |     |
| ORANGE                 | 9           | 58          | 60        | 9,424               | 電気通信サービス     |     |
| HERMES INTERNATIONAL   | —           | 0.98        | 186       | 29,158              | 耐久消費財・アパレル   |     |
| DASSAULT SYSTEMES SA   | —           | 20          | 81        | 12,815              | ソフトウェア・サービス  |     |
| KERING                 | 0.36        | 2           | 117       | 18,310              | 耐久消費財・アパレル   |     |
| CARREFOUR              | 2           | 21          | 34        | 5,393               | 生活必需品流通・小売り  |     |
| ACCOR                  | 0.83        | —           | —         | —                   | 消費者サービス      |     |
| SOCIETE GENERALE       | 3           | 23          | 52        | 8,230               | 銀行           |     |
| TELEPERFORMANCE        | 0.28        | 1           | 26        | 4,097               | 商業・専門サービス    |     |
| AXA SA                 | 9           | 57          | 151       | 23,779              | 保険           |     |
| ESSILORLUXOTTICA       | 1           | —           | —         | —                   | ヘルスケア機器・サービス |     |
| CREDIT AGRICOLE SA     | —           | 37          | 39        | 6,130               | 銀行           |     |
| BNP PARIBAS            | 5           | 33          | 182       | 28,615              | 銀行           |     |
| DANONE (GROUPE)        | 3           | 20          | 115       | 18,054              | 食品・飲料・タバコ    |     |
| ALSTOM                 | 1           | —           | —         | —                   | 資本財          |     |
| EIFFAGE                | 0.4         | 2           | 27        | 4,314               | 資本財          |     |
| ADP                    | —           | 0.92        | 12        | 1,901               | 運輸           |     |

| 銘柄                           | 株数<br>(百株)               | 当期首(前期末) | 当 期 末       |         | 業 種              |       |
|------------------------------|--------------------------|----------|-------------|---------|------------------|-------|
|                              |                          |          | 株 数<br>(百株) | 評 価 額   |                  |       |
|                              |                          |          |             |         |                  | 外貨建金額 |
| BUREAU VERITAS SA            | 1                        | —        | —           | —       | 商業・専門サービス        |       |
| GETLINK                      | —                        | 13       | 21          | 3,303   | 運輸               |       |
| BIOMERIEUX                   | 0.6                      | —        | —           | —       | ヘルスケア機器・サービス     |       |
| WORLDFINE SA                 | 1                        | 8        | 27          | 4,255   | 金融サービス           |       |
| 国 小 計                        | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数 <比 率> | 71       | 441         | 2,876   | 450,106          |       |
|                              |                          | 25       | 22          | —       | <3.8%>           |       |
| (オランダ)                       |                          |          |             |         |                  |       |
| RANDSTAD NV                  | 0.58                     | —        | —           | —       | 商業・専門サービス        |       |
| KONINKLIJKE AHOLD NV         | 4                        | 30       | 91          | 14,309  | 生活必需品流通・小売り      |       |
| AKZO NOBEL                   | 0.91                     | 5        | 37          | 5,895   | 素材               |       |
| WOLTERS KLUWER               | 1                        | 7        | 89          | 13,949  | 商業・専門サービス        |       |
| KONINKLIJKE DSM NV           | 0.82                     | —        | —           | —       | 素材               |       |
| ASML HOLDING NV              | 2                        | 12       | 798         | 124,939 | 半導体・半導体製造装置      |       |
| KPN (KON.)                   | 16                       | 98       | 31          | 4,938   | 電気通信サービス         |       |
| STMICROELECTRONICS NV        | —                        | 21       | 90          | 14,096  | 半導体・半導体製造装置      |       |
| ING GROEP NV-CVA             | 18                       | 115      | 135         | 21,206  | 銀行               |       |
| CNH INDUSTRIAL NV            | 4                        | 30       | 38          | 6,056   | 資本財              |       |
| PROSUS                       | 4                        | 23       | 150         | 23,490  | 一般消費財・サービス流通・小売り |       |
| JDE PEET'S BV                | 0.38                     | 3        | 8           | 1,376   | 食品・飲料・タバコ        |       |
| IMCD NV                      | 0.3                      | —        | —           | —       | 資本財              |       |
| NN GROUP NV                  | 1                        | 8        | 26          | 4,179   | 保険               |       |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP NV     | —                        | 26       | 51          | 8,048   | メディア・娯楽          |       |
| JUST EAT TAKEAWAY            | —                        | 7        | 9           | 1,525   | 消費者サービス          |       |
| 国 小 計                        | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数 <比 率> | 56       | 390         | 1,559   | 244,011          |       |
|                              |                          | 13       | 13          | —       | <2.0%>           |       |
| (スペイン)                       |                          |          |             |         |                  |       |
| IBERDROLA SA                 | 28                       | 179      | 209         | 32,712  | 公益事業             |       |
| BANCO BILBAO VIZCAYA         | 32                       | —        | —           | —       | 銀行               |       |
| NATURGY ENERGY GROUP SA      | 1                        | 4        | 12          | 1,914   | 公益事業             |       |
| REPSOL SA                    | 7                        | 42       | 54          | 8,565   | エネルギー            |       |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 2                        | 10       | 16          | 2,609   | 公益事業             |       |
| INDITEX                      | 5                        | —        | —           | —       | 一般消費財・サービス流通・小売り |       |
| ACS ACTIV. CONST. Y SVCS     | —                        | 7        | 22          | 3,498   | 資本財              |       |
| AMADEUS IT GROUP SA-A SHS    | —                        | 13       | 95          | 14,896  | 消費者サービス          |       |
| 国 小 計                        | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数 <比 率> | 75       | 257         | 410     | 64,197           |       |
|                              |                          | 6        | 6           | —       | <0.5%>           |       |
| (ベルギー)                       |                          |          |             |         |                  |       |
| UMICORE                      | 0.93                     | 5        | 14          | 2,262   | 素材               |       |
| D' IETEREN GROUP             | 0.19                     | —        | —           | —       | 一般消費財・サービス流通・小売り |       |
| KBC GROEP NV                 | 1                        | 8        | 50          | 7,964   | 銀行               |       |
| SOLVAY SA                    | 0.35                     | —        | —           | —       | 素材               |       |
| 国 小 計                        | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数 <比 率> | 2        | 14          | 65      | 10,227           |       |
|                              |                          | 4        | 2           | —       | <0.1%>           |       |
| (オーストリア)                     |                          |          |             |         |                  |       |
| OMV AG                       | 0.69                     | 4        | 16          | 2,633   | エネルギー            |       |
| VERBUND AG                   | 0.47                     | 1        | 13          | 2,140   | 公益事業             |       |

| 銘柄                          | 当期首(前期末)                 |             | 当 期 末       |                     | 業 種                    |
|-----------------------------|--------------------------|-------------|-------------|---------------------|------------------------|
|                             | 株 数<br>(百株)              | 株 数<br>(百株) | 評 価 額       |                     |                        |
|                             |                          |             | 外 貨 建 金 額   | 邦 貨 換 算 金 額<br>(千円) |                        |
| VOESTALPINE AG              | 0.55                     | —           | —           | —                   | 素材                     |
| 国 小 計                       | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数 <比 率> | 1<br>3      | 6<br>2      | 30<br>—             | 4,774<br><0.0%>        |
| (ルクセンブルク)                   |                          |             |             |                     |                        |
| TENARIS SA                  | 2                        | 17          | 22          | 3,508               | エネルギー                  |
| 国 小 計                       | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数 <比 率> | 2<br>1      | 17<br>1     | 22<br>—             | 3,508<br><0.0%>        |
| (フィンランド)                    |                          |             |             |                     |                        |
| KESKO OYJ-B SHS             | 1                        | 6           | 11          | 1,830               | 生活必需品流通・小売り            |
| WARTSILA OYJ                | 2                        | 13          | 13          | 2,125               | 資本財                    |
| UPM KYMMENE OYJ             | 2                        | 15          | 42          | 6,604               | 素材                     |
| STORA ENSO OYJ R            | 2                        | 20          | 21          | 3,423               | 素材                     |
| SAMPO OYJ-A SHS             | 2                        | —           | —           | —                   | 保険                     |
| ELISA A                     | 0.67                     | 5           | 26          | 4,107               | 電気通信サービス               |
| NOKIA OYJ                   | —                        | 165         | 62          | 9,706               | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| NESTE OIL OYJ               | 1                        | 12          | 42          | 6,684               | エネルギー                  |
| ORTON OYJ-CLASS B           | 0.5                      | —           | —           | —                   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| METSO CORPORATION           | —                        | 21          | 23          | 3,647               | 資本財                    |
| 国 小 計                       | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数 <比 率> | 14<br>8     | 261<br>8    | 243<br>—            | 38,130<br><0.3%>       |
| (アイルランド)                    |                          |             |             |                     |                        |
| KINGSPAN GROUP PLC          | 0.73                     | 5           | 29          | 4,606               | 資本財                    |
| CRH PLC                     | 3                        | 22          | 107         | 16,878              | 素材                     |
| KERRY GROUP PLC-A           | 0.75                     | 4           | 40          | 6,351               | 食品・飲料・タバコ              |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC     | 1                        | 8           | 24          | 3,871               | 素材                     |
| 国 小 計                       | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数 <比 率> | 6<br>4      | 40<br>4     | 202<br>—            | 31,707<br><0.3%>       |
| (ポルトガル)                     |                          |             |             |                     |                        |
| GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 2                        | 14          | 15          | 2,368               | エネルギー                  |
| JERONIMO MARTINS            | 1                        | 8           | 21          | 3,411               | 生活必需品流通・小売り            |
| 国 小 計                       | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数 <比 率> | 3<br>2      | 22<br>2     | 36<br>—             | 5,779<br><0.0%>        |
| (その他)                       |                          |             |             |                     |                        |
| DSM-FIRMENICH AG            | —                        | 5           | 47          | 7,492               | 素材                     |
| 国 小 計                       | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数 <比 率> | —<br>—      | 5<br>1      | 47<br>—             | 7,492<br><0.1%>        |
| ユ ー ロ 計                     | 株 数 ・ 金 額<br>銘 柄 数 <比 率> | 391<br>95   | 2,101<br>95 | 6,956<br>—          | 1,088,562<br><9.1%>    |
| (イギリス)                      |                          |             |             |                     |                        |
| ANTOFAGASTA PLC             | 1                        | 10          | 14          | 2,656               | 素材                     |
| ASHTAD GROUP PLC            | 2                        | 12          | 69          | 12,634              | 資本財                    |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC    | 4                        | 26          | 10          | 1,944               | 耐久消費財・アパレル             |
| BUNZL PLC                   | 1                        | —           | —           | —                   | 資本財                    |
| CRODA INTERNATIONAL PLC     | 0.67                     | 4           | 22          | 4,187               | 素材                     |
| SCHRODERS PLC               | 0.61                     | 23          | 10          | 1,837               | 金融サービス                 |
| DCC PLC                     | 0.48                     | 2           | 10          | 1,979               | 資本財                    |

| 銘柄                           | 当期首(前期末)     | 当 期 末       |           |                     | 業 種                    |  |
|------------------------------|--------------|-------------|-----------|---------------------|------------------------|--|
|                              | 株 数<br>(百株)  | 株 数<br>(百株) | 評 価 額     |                     |                        |  |
|                              |              |             | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額<br>(千円) |                        |  |
| JOHNSON MATTHEY PLC          | 0.94         | 4           | 7         | 1,445               | 素材                     |  |
| ANGLO AMERICAN PLC           | —            | 39          | 88        | 16,135              | 素材                     |  |
| COMPASS GROUP PLC            | 8            | —           | —         | —                   | 消費者サービス                |  |
| HSBC HOLDINGS PLC (GB)       | 102          | 622         | 374       | 68,501              | 銀行                     |  |
| LEGAL & GENERAL GROUP        | 28           | 174         | 38        | 7,111               | 保険                     |  |
| UNILEVER PLC                 | 12           | 76          | 314       | 57,385              | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 1            | 13          | 25        | 4,645               | 食品・飲料・タバコ              |  |
| PEARSON                      | 3            | —           | —         | —                   | 消費者サービス                |  |
| PERSIMMON PLC                | 2            | —           | —         | —                   | 耐久消費財・アパレル             |  |
| PRUDENTIAL                   | 14           | 86          | 93        | 17,078              | 保険                     |  |
| VODAFONE GROUP PLC           | 127          | 772         | 56        | 10,252              | 電気通信サービス               |  |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC  | 3            | 21          | 131       | 24,077              | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| RELX PLC                     | 9            | 59          | 154       | 28,243              | 商業・専門サービス              |  |
| RENTOKIL INITIAL PLC         | 8            | —           | —         | —                   | 商業・専門サービス              |  |
| ST JAMES'S PLACE PLC         | 2            | 19          | 20        | 3,708               | 金融サービス                 |  |
| SAGE GROUP PLC               | —            | 32          | 27        | 5,095               | ソフトウェア・サービス            |  |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     | 336          | 2,009       | 85        | 15,540              | 銀行                     |  |
| TAYLOR WIMPEY PLC            | 17           | 91          | 9         | 1,689               | 耐久消費財・アパレル             |  |
| TESCO PLC                    | 36           | 220         | 54        | 10,003              | 生活必需品流通・小売り            |  |
| 3I GROUP PLC                 | —            | 30          | 55        | 10,208              | 金融サービス                 |  |
| GSK PLC                      | 23           | —           | —         | —                   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| WPP PLC                      | 5            | 32          | 27        | 4,974               | メディア・娯楽                |  |
| ASTRAZENECA                  | 7            | 48          | 548       | 100,202             | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| BT GROUP PLC                 | 42           | 205         | 26        | 4,792               | 電気通信サービス               |  |
| NATIONAL GRID PLC            | 20           | 113         | 118       | 21,613              | 公益事業                   |  |
| INTERTEK GROUP PLC           | 0.77         | 5           | 23        | 4,320               | 商業・専門サービス              |  |
| BURBERRY GROUP PLC           | 1            | 12          | 27        | 5,039               | 耐久消費財・アパレル             |  |
| NEXT PLC                     | 0.63         | —           | —         | —                   | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| KINGFISHER PLC               | 10           | 51          | 11        | 2,100               | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| SAINSBURY (J) PLC            | 8            | 45          | 11        | 2,125               | 生活必需品流通・小売り            |  |
| ADMIRAL GROUP PLC            | —            | 6           | 13        | 2,535               | 保険                     |  |
| BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE  | 0.54         | 2           | 10        | 1,957               | 耐久消費財・アパレル             |  |
| INTERCONTINENTAL HOTELS      | 0.88         | —           | —         | —                   | 消費者サービス                |  |
| WHITBREAD PLC                | 0.98         | —           | —         | —                   | 消費者サービス                |  |
| ABRDN PLC                    | 10           | 68          | 14        | 2,598               | 金融サービス                 |  |
| MONDI PLC                    | 2            | 16          | 19        | 3,489               | 素材                     |  |
| OCADO GROUP PLC              | 4            | 18          | 9         | 1,810               | 生活必需品流通・小売り            |  |
| COCA-COLA HBC AG-CDI         | 0.98         | 9           | 22        | 4,127               | 食品・飲料・タバコ              |  |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC   | —            | 23          | 12        | 2,247               | 保険                     |  |
| FERGUSON PLC                 | 1            | —           | —         | —                   | 資本財                    |  |
| ENDEAVOUR MINING PLC         | —            | 6           | 11        | 2,067               | 素材                     |  |
| INFORMA PLC                  | 7            | 43          | 30        | 5,507               | メディア・娯楽                |  |
| AUTO TRADER GROUP PLC        | —            | 28          | 16        | 3,069               | メディア・娯楽                |  |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 0.35         | 2           | 25        | 4,589               | 資本財                    |  |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 881         | 5,093     | 2,657               | 485,531                |  |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 44          | 41        | —                   | < 4.1% >               |  |

| 銘柄                                | 当期末(前期末)    | 期 末         |             |                     | 業 種                    |  |
|-----------------------------------|-------------|-------------|-------------|---------------------|------------------------|--|
|                                   | 株 数<br>(百株) | 株 数<br>(百株) | 評 価 額       |                     |                        |  |
|                                   |             |             | 外 貨 建 金 額   | 邦 貨 換 算 金 額<br>(千円) |                        |  |
| (スイス)                             |             |             | 千スイスフラン     |                     |                        |  |
| SIKA AG-BR                        | 0.68        | 4           | 110         | 17,678              | 素材                     |  |
| SGS SA                            | 0.03        | 4           | 39          | 6,403               | 商業・専門サービス              |  |
| SWISSCOM                          | —           | 0.8         | 44          | 7,126               | 電気通信サービス               |  |
| GEBERIT AG-REG                    | 0.18        | 1           | 47          | 7,573               | 資本財                    |  |
| LINDT & SPRUENGLI AG-PC           | 0.01        | 0.06        | 65          | 10,473              | 食品・飲料・タバコ              |  |
| GIVAUDAN-REG                      | 0.05        | 0.28        | 82          | 13,264              | 素材                     |  |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG         | —           | 4           | 200         | 32,042              | 保険                     |  |
| NOVARTIS                          | —           | 63          | 574         | 92,038              | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| ABB LTD                           | 8           | 47          | 162         | 25,971              | 資本財                    |  |
| ROCHE HOLDING GENUSS              | 3           | —           | —           | —                   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| ADECCO GROUP AG-REG               | 0.75        | —           | —           | —                   | 商業・専門サービス              |  |
| CLARIANT AG-REG                   | 1           | 5           | 7           | 1,178               | 素材                     |  |
| BALOISE HOLDING AG - REG          | —           | 1           | 21          | 3,477               | 保険                     |  |
| TEMENOS AG - REG                  | 0.8         | 2           | 13          | 2,215               | ソフトウェア・サービス            |  |
| SONOVA HOLDING AG-REG             | 0.26        | 1           | 36          | 5,863               | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG        | 0.26        | 1           | 41          | 6,626               | 運輸                     |  |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG          | 0.5         | —           | —           | —                   | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| LONZA GROUP AG-REG                | 0.36        | 2           | 123         | 19,854              | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| SWISS LIFE HOLDING AG-REG         | 0.15        | 0.92        | 48          | 7,805               | 保険                     |  |
| LOGITECH INTERNATIONAL-REG        | —           | 5           | 25          | 4,059               | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD) | 2           | —           | —           | —                   | 耐久消費財・アパレル             |  |
| JULIUS BAER GROUP LTD             | —           | 7           | 38          | 6,123               | 金融サービス                 |  |
| SWISS RE LTD                      | 1           | 9           | 82          | 13,252              | 保険                     |  |
| SIG GROUP AG                      | —           | 10          | 24          | 3,946               | 素材                     |  |
| BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG      | —           | 1           | 13          | 2,145               | 銀行                     |  |
| VIFOR PHARMA AG/NEW               | 0.24        | —           | —           | —                   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| VAT GROUP AG                      | —           | 0.83        | 29          | 4,659               | 資本財                    |  |
| 小 計                               | 株 数 ・ 金 額   | 21          | 176         | 1,834               | 293,779                |  |
|                                   | 銘 柄 数 <比 率> | 18          | 22          | —                   | <2.5%>                 |  |
| (スウェーデン)                          |             |             | 千スウェーデンクローナ |                     |                        |  |
| ATLAS COPCO A                     | 15          | 86          | 1,326       | 17,777              | 資本財                    |  |
| SKF AB-B                          | 1           | 10          | 192         | 2,577               | 資本財                    |  |
| SCA SV CELLULOSA B                | 2           | 15          | 216         | 2,903               | 素材                     |  |
| HOLMEN AB-B SHARES                | 0.69        | 2           | 112         | 1,506               | 素材                     |  |
| TELE2 AB-B SHS                    | 2           | 15          | 134         | 1,796               | 電気通信サービス               |  |
| ELECTROLUX AB-SER B               | 1           | —           | —           | —                   | 耐久消費財・アパレル             |  |
| HENNES & MAURITZ B                | 3           | 18          | 295         | 3,953               | 一般消費財・サービス流通・小売り       |  |
| ASSA ABLOY AB-B                   | 4           | 29          | 717         | 9,609               | 資本財                    |  |
| SVENSKA HANDELSBK A               | —           | 46          | 407         | 5,462               | 銀行                     |  |
| ERICSSON (LM) B                   | 14          | —           | —           | —                   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| SANDVIK AB                        | 5           | 31          | 634         | 8,497               | 資本財                    |  |
| TELIA CO AB                       | 12          | 79          | 183         | 2,461               | 電気通信サービス               |  |
| BOLIDEN AB                        | 1           | 9           | 297         | 3,983               | 素材                     |  |
| ALFA LAVAL AB                     | 1           | 10          | 407         | 5,455               | 資本財                    |  |
| KINNEVIK AB - B                   | —           | 9           | 127         | 1,715               | 金融サービス                 |  |

| 銘柄                          | 株数<br>(百株)              | 当期首(前期末) | 当 期 末       |         | 業 種                    |           |
|-----------------------------|-------------------------|----------|-------------|---------|------------------------|-----------|
|                             |                         |          | 株 数<br>(百株) | 評 価 額   |                        |           |
|                             |                         |          |             |         |                        | 外 貨 建 金 額 |
| HUSQVARNA AB-B SHS          | 1                       | 13       | 129         | 1,740   | 資本財                    |           |
| ATLAS COPCO B               | 7                       | 45       | 613         | 8,216   | 資本財                    |           |
| EPIROC AB-A                 | 3                       | 19       | 381         | 5,109   | 資本財                    |           |
| EPIROC AB-B                 | 2                       | 10       | 173         | 2,327   | 資本財                    |           |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B         | 2                       | 17       | 511         | 6,852   | 家庭用品・パーソナル用品           |           |
| EQT AB                      | 1                       | 12       | 257         | 3,449   | 金融サービス                 |           |
| BELJER REF AB               | —                       | 10       | 138         | 1,855   | 資本財                    |           |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS    | 6                       | 44       | 448         | 6,012   | 資本財                    |           |
| NORDEA BANK ABP             | 15                      | 98       | 1,105       | 14,820  | 銀行                     |           |
| 小 計                         | 株 数 ・ 金 額<br>銘柄 数 <比 率> | 109      | 637         | 8,812   | 118,083                |           |
|                             |                         | 21       | 22          | —       | <1.0%>                 |           |
| (ノルウェー)                     |                         |          | 千ノルウェークローネ  |         |                        |           |
| NORSK HYDRO                 | 6                       | 40       | 250         | 3,327   | 素材                     |           |
| TELENOR ASA                 | 3                       | 21       | 231         | 3,074   | 電気通信サービス               |           |
| ORKLA                       | 3                       | 21       | 163         | 2,164   | 食品・飲料・タバコ              |           |
| EQUINOR ASA                 | 5                       | 28       | 870         | 11,559  | エネルギー                  |           |
| MOWI ASA                    | 2                       | 11       | 198         | 2,634   | 食品・飲料・タバコ              |           |
| AKER BP ASA                 | 1                       | 10       | 267         | 3,555   | エネルギー                  |           |
| SALMAR ASA                  | 0.45                    | 2        | 85          | 1,135   | 食品・飲料・タバコ              |           |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA   | 1                       | 6        | 104         | 1,383   | 保険                     |           |
| DNB BANK ASA                | 4                       | 27       | 518         | 6,887   | 銀行                     |           |
| 小 計                         | 株 数 ・ 金 額<br>銘柄 数 <比 率> | 27       | 168         | 2,689   | 35,722                 |           |
|                             |                         | 9        | 9           | —       | <0.3%>                 |           |
| (デンマーク)                     |                         |          | 千デンマーククローネ  |         |                        |           |
| A P MOLLER-MAERSK A/S-B     | 0.03                    | 0.18     | 212         | 4,464   | 運輸                     |           |
| A P MOLLER - MAERSK A/S - A | 0.02                    | 0.08     | 93          | 1,964   | 運輸                     |           |
| GN STORE NORD A/S           | 0.62                    | —        | —           | —       | ヘルスケア機器・サービス           |           |
| GENMAB A/S                  | 0.31                    | 2        | 549         | 11,550  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |           |
| NOVOZYMES A/S               | 1                       | 6        | 192         | 4,046   | 素材                     |           |
| ROCKWOOL A/S-B SHS          | —                       | 0.5      | 81          | 1,712   | 資本財                    |           |
| DSV A/S                     | —                       | 5        | 787         | 16,554  | 運輸                     |           |
| DEMANT A/S                  | 0.53                    | —        | —           | —       | ヘルスケア機器・サービス           |           |
| VESTAS WIND SYSEMS A/S      | 4                       | 29       | 528         | 11,110  | 資本財                    |           |
| NOVO NORDISK A/S-B          | 8                       | 51       | 5,568       | 116,989 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |           |
| COLOPLAST-B                 | 0.57                    | 3        | 299         | 6,293   | ヘルスケア機器・サービス           |           |
| PANDORA A/S                 | 0.48                    | 2        | 138         | 2,917   | 耐久消費財・アパレル             |           |
| CHR HANSEN HOLDING A/S      | 0.51                    | 2        | 131         | 2,764   | 素材                     |           |
| ORSTED A/S                  | 0.9                     | 5        | 345         | 7,268   | 公益事業                   |           |
| 小 計                         | 株 数 ・ 金 額<br>銘柄 数 <比 率> | 18       | 109         | 8,930   | 187,637                |           |
|                             |                         | 12       | 12          | —       | <1.6%>                 |           |
| (オーストラリア)                   |                         |          | 千オーストラリアドル  |         |                        |           |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD      | 0.87                    | 7        | 38          | 3,708   | ヘルスケア機器・サービス           |           |
| AUST AND NZ BANKING GROUP   | 13                      | —        | —           | —       | 銀行                     |           |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD  | 8                       | 49       | 105         | 10,112  | 素材                     |           |
| TELSTRA CORP                | 19                      | —        | —           | —       | 電気通信サービス               |           |
| BRAMBLES LTD                | 6                       | 42       | 59          | 5,709   | 商業・専門サービス              |           |



| 銘柄                           | 当期首(前期末)                |             | 当 期 末       |                     | 業 種               |
|------------------------------|-------------------------|-------------|-------------|---------------------|-------------------|
|                              | 株 数<br>(百株)             | 株 数<br>(百株) | 価 額         |                     |                   |
|                              |                         |             | 外 貨 建 金 額   | 邦 貨 換 算 金 額<br>(千円) |                   |
| ASX LTD                      | 0.92                    | 6           | 41          | 4,013               | 金融サービス            |
| COMPUTERSHARE LIMITED        | 2                       | 16          | 36          | 3,512               | 商業・専門サービス         |
| REA GROUP LTD                | 0.25                    | 2           | 31          | 2,986               | メディア・娯楽           |
| TRANSURBAN GROUP             | 18                      | 103         | 147         | 14,110              | 運輸                |
| COCHLEAR LIMITED             | 0.31                    | 2           | 48          | 4,650               | ヘルスケア機器・サービス      |
| COMMONWEALTH BANK OF AUST    | 8                       | —           | —           | —                   | 銀行                |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD       | 2                       | 17          | 67          | 6,439               | 消費者サービス           |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC  | 1                       | 13          | 51          | 4,907               | 素材                |
| IGO LTD                      | —                       | 25          | 39          | 3,744               | 素材                |
| ORICA LTD                    | 2                       | 11          | 17          | 1,642               | 素材                |
| BLUESCOPE STEEL LTD          | 2                       | 12          | 24          | 2,341               | 素材                |
| MACQUARIE GROUP LIMITED      | 1                       | 11          | 196         | 18,814              | 金融サービス            |
| SUNCORP GROUP LIMITED        | 7                       | 44          | 60          | 5,757               | 保険                |
| NEWCREST MINING LIMITED      | 3                       | 26          | 68          | 6,553               | 素材                |
| QBE INSURANCE GROUP          | 7                       | 43          | 67          | 6,452               | 保険                |
| NORTHERN STAR RESOURCES LTD  | 5                       | 40          | 49          | 4,757               | 素材                |
| SANTOS                       | 17                      | —           | —           | —                   | エネルギー             |
| SONIC HEALTHCARE LTD         | 2                       | 14          | 49          | 4,764               | ヘルスケア機器・サービス      |
| WOODSIDE ENERGY GROUP LTD    | 4                       | 59          | 200         | 19,219              | エネルギー             |
| SEEK LTD                     | 1                       | 8           | 18          | 1,771               | メディア・娯楽           |
| DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L | 0.54                    | —           | —           | —                   | 消費者サービス           |
| MINERAL RESOURCES LTD        | 0.8                     | 5           | 40          | 3,893               | 素材                |
| PILBARA MINERALS LTD         | —                       | 90          | 44          | 4,223               | 素材                |
| EVOLUTION MINING LTD         | 8                       | —           | —           | —                   | 素材                |
| AURIZON HOLDINGS LTD         | 8                       | 46          | 18          | 1,727               | 運輸                |
| XERO LTD                     | 0.62                    | 5           | 59          | 5,694               | ソフトウェア・サービス       |
| IDP EDUCATION LTD            | 1                       | 6           | 14          | 1,359               | 消費者サービス           |
| TELSTRA GROUP LTD            | —                       | 120         | 51          | 4,977               | 電気通信サービス          |
| ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI | 12                      | 33          | 21          | 2,025               | 生活必需品流通・小売り       |
| ANZ GROUP HOLDINGS LTD       | —                       | 92          | 210         | 20,195              | 銀行                |
| COLES GROUP LTD              | 6                       | 39          | 72          | 6,900               | 生活必需品流通・小売り       |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額<br>銘柄 数 <比 率> | 181<br>32   | 999<br>30   | 1,952<br>—          | 186,967<br><1.6%> |
| (ニュージーランド)                   |                         |             | 千ニュージーランドドル |                     |                   |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD    | 5                       | —           | —           | —                   | 運輸                |
| EBOS GROUP LTD               | —                       | 5           | 19          | 1,712               | ヘルスケア機器・サービス      |
| FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 2                       | —           | —           | —                   | ヘルスケア機器・サービス      |
| SPARK NEW ZEALAND LTD        | 8                       | 57          | 29          | 2,579               | 電気通信サービス          |
| MERCURY NZ LTD               | 3                       | 23          | 14          | 1,324               | 公益事業              |
| MERIDIAN ENERGY LTD          | 6                       | 40          | 21          | 1,909               | 公益事業              |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額<br>銘柄 数 <比 率> | 26<br>5     | 125<br>4    | 85<br>—             | 7,525<br><0.1%>   |
| (香港)                         |                         |             | 千香港ドル       |                     |                   |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L | 5                       | —           | —           | —                   | 公益事業              |
| MTR CORP                     | 5                       | 40          | 144         | 2,652               | 運輸                |
| HANG SENG BANK               | 3                       | 24          | 268         | 4,920               | 銀行                |

| 銘柄                           | 銘柄                      | 当期首(前期末)     | 当 期 末         |            | 業 種                   |                     |
|------------------------------|-------------------------|--------------|---------------|------------|-----------------------|---------------------|
|                              |                         | 株 数<br>(百株)  | 株 数<br>(百株)   | 評 価 額      |                       |                     |
|                              |                         |              |               | 外 貨 建 金 額  |                       | 邦 貨 換 算 金 額<br>(千円) |
| HONG KONG & CHINA GAS        |                         | 50           | 300           | 202        | 3,709                 | 公益事業                |
| BOC HONG KONG HOLDINGS -R    |                         | 15           | 115           | 276        | 5,056                 | 銀行                  |
| SINO LAND CO                 |                         | 20           | 100           | 93         | 1,720                 | 不動産管理・開発            |
| SWIRE PACIFIC A              |                         | 5            | 15            | 78         | 1,438                 | 不動産管理・開発            |
| CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU |                         | 10           | —             | —          | —                     | 一般消費財・サービス流通・小売り    |
| AIA GROUP LTD                |                         | 62           | 362           | 2,829      | 51,827                | 保険                  |
| SWIRE PROPERTIES LTD         |                         | 6            | 38            | 71         | 1,303                 | 不動産管理・開発            |
| WH GROUP LTD                 |                         | 60           | 240           | 100        | 1,846                 | 食品・飲料・タバコ           |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額<br>銘柄 数 <比 率> | 241<br>11    | 1,234<br>9    | 4,065<br>— | 74,475<br><0.6%>      |                     |
| (シンガポール)                     |                         |              |               | 千シンガポールドル  |                       |                     |
| CITY DEVELOPMENTS LTD        |                         | 2            | 13            | 8          | 927                   | 不動産管理・開発            |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD       |                         | 4            | 24            | 22         | 2,441                 | 金融サービス              |
| KEPPEL CORP LTD              |                         | 7            | 43            | 28         | 3,031                 | 資本財                 |
| SINGAPORE AIRLINES           |                         | 6            | —             | —          | —                     | 運輸                  |
| UNITED OVERSEAS BANK         |                         | 6            | 38            | 106        | 11,294                | 銀行                  |
| UOL GROUP LIMITED            |                         | 2            | —             | —          | —                     | 不動産管理・開発            |
| CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI |                         | 12           | 78            | 25         | 2,708                 | 不動産管理・開発            |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額<br>銘柄 数 <比 率> | 39<br>7      | 196<br>5      | 192<br>—   | 20,404<br><0.2%>      |                     |
| (イスラエル)                      |                         |              |               | 千イスラエルシェケル |                       |                     |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL         |                         | 6            | 45            | 124        | 4,925                 | 銀行                  |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額<br>銘柄 数 <比 率> | 6<br>1       | 45<br>1       | 124<br>—   | 4,925<br><0.0%>       |                     |
| 合 計                          | 株 数 ・ 金 額<br>銘柄 数 <比 率> | 2,742<br>562 | 16,191<br>575 | —<br>—     | 11,367,563<br><95.2%> |                     |

(注1) 邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<外国投資信託受益証券、投資証券>

| 銘柄                            | 当期首(前期末)    |             | 当 期 末      |                     |         |
|-------------------------------|-------------|-------------|------------|---------------------|---------|
|                               | 口 数<br>(千口) | 口 数<br>(千口) | 評 価 額      |                     |         |
|                               |             |             | 外 貨 建 金 額  | 邦 貨 換 算 金 額<br>(千円) |         |
| (アメリカ)                        |             |             | 千米ドル       |                     |         |
| BOSTON PROPERTIES             | 0.07        | 0.522       | 26         | 3,857               |         |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC | 0.675       | 1           | 29         | 4,215               |         |
| PROLOGIS INC                  | 0.352       | 2           | 338        | 48,543              |         |
| CROWN CASTLE INC              | 0.205       | 1           | 145        | 20,948              |         |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC     | 0.25        | 1           | 30         | 4,385               |         |
| WELLTOWER INC                 | 0.19        | 1           | 112        | 16,122              |         |
| IRON MOUNTAIN INC             | —           | 0.95        | 51         | 7,356               |         |
| VENTAS INC                    | 0.25        | —           | —          | —                   |         |
| DIGITAL REALTY TRUST INC      | —           | 0.95        | 98         | 14,197              |         |
| AMERICAN TOWER CORPORATION    | 0.236       | 1           | 266        | 38,225              |         |
| EQUINIX INC                   | 0.042       | 0.284       | 211        | 30,404              |         |
| SBA COMMUNICATIONS CORP       | 0.065       | 0.341       | 76         | 10,915              |         |
| 小 計                           | 口 数 ・ 金 額   | 2           | 13         | 1,388               | 199,172 |
|                               | 銘 柄 数 <比 率> | 10          | 11         | —                   | <1.7%>  |
| (カナダ)                         |             |             | 千カナダドル     |                     |         |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA  | 0.042       | 0.278       | 13         | 1,447               |         |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR   | —           | 0.55        | 10         | 1,101               |         |
| 小 計                           | 口 数 ・ 金 額   | 0.042       | 0.828      | 23                  | 2,549   |
|                               | 銘 柄 数 <比 率> | 1           | 2          | —                   | <0.0%>  |
| (フランス)                        |             |             | 千ユーロ       |                     |         |
| KLEPIERRE                     | 0.102       | 0.568       | 12         | 1,936               |         |
| GECINA SA                     | 0.022       | 0.121       | 11         | 1,776               |         |
| COVIVIO(FP)                   | 0.026       | —           | —          | —                   |         |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD     | 0.06        | —           | —          | —                   |         |
| ユーロ計                          | 口 数 ・ 金 額   | 0.21        | 0.689      | 23                  | 3,713   |
|                               | 銘 柄 数 <比 率> | 4           | 2          | —                   | <0.0%>  |
| (イギリス)                        |             |             | 千イギリスポンド   |                     |         |
| BRITISH LAND CO PLC           | 0.434       | —           | —          | —                   |         |
| SEGRO PLC                     | 0.571       | 3           | 25         | 4,594               |         |
| LAND SECURITIES GROUP PLC     | 0.5         | —           | —          | —                   |         |
| 小 計                           | 口 数 ・ 金 額   | 1           | 3          | 25                  | 4,594   |
|                               | 銘 柄 数 <比 率> | 3           | 1          | —                   | <0.0%>  |
| (オーストラリア)                     |             |             | 千オーストラリアドル |                     |         |
| MIRVAC GROUP                  | 1           | 9           | 21         | 2,105               |         |
| APA GROUP                     | 0.561       | 2           | 29         | 2,822               |         |
| GPT GROUP                     | 0.927       | 4           | 19         | 1,872               |         |

| 銘 柄                                    | 当期首(前期末)    |             | 当 期 末     |                     |         |
|--|-------------|-------------|-----------|---------------------|---------|
|  | 口 数<br>(千口) | 口 数<br>(千口) | 評 価 額     |                     |         |
|  |             |             | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額<br>(千円) |         |
| STOCKLAND                              | 1           | 6           | 24        | 2,321               |         |
| DEXUS                                  | 0.517       | 2           | 20        | 1,994               |         |
| GOODMAN GROUP                          | 0.791       | 5           | 111       | 10,717              |         |
| VICINITY CENTERS                       | 1           | 9           | 17        | 1,691               |         |
| LENLEASE GROUP                         | 0.327       | 1           | 12        | 1,180               |         |
| SCENTRE GROUP                          | 3           | 15          | 38        | 3,699               |         |
| 小 計                                    | 口 数 ・ 金 額   | 11          | 59        | 296                 | 28,404  |
|  | 銘 柄 数 <比 率> | 9           | 9         | —                   | <0.2%>  |
| (香港)                                   |             |             | 千香港ドル     |                     |         |
| HKT TRUST AND HKT LTD                  | 2           | 11          | 99        | 1,823               |         |
| 小 計                                    | 口 数 ・ 金 額   | 2           | 11        | 99                  | 1,823   |
|  | 銘 柄 数 <比 率> | 1           | 1         | —                   | <0.0%>  |
| (シンガポール)                               |             |             | 千シンガポールドル |                     |         |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 2           | 14          | 28        | 2,998               |         |
| 小 計                                    | 口 数 ・ 金 額   | 2           | 14        | 28                  | 2,998   |
|  | 銘 柄 数 <比 率> | 1           | 1         | —                   | <0.0%>  |
| 合 計                                    | 口 数 ・ 金 額   | 19          | 103       | —                   | 243,256 |
|  | 銘 柄 数 <比 率> | 29          | 27        | —                   | <2.0%>  |

(注1) 邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

### <先物取引の銘柄別期末残高>

| 銘 柄 別           | 当 期 末          |                |
|-----------------|----------------|----------------|
|                 | 買 建 額<br>(百万円) | 売 建 額<br>(百万円) |
| 外国 S&P 500 EMIN | 251            | —              |
| DJ EURO STOXX   | 60             | —              |

(注) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

## 投資信託財産の構成

| 項 目                     | 当 期 末      |       |
|-------------------------|------------|-------|
|                         | 評 価 額      | 比 率   |
|                         | 千円         | %     |
| 株 式                     | 11,367,563 | 95.2  |
| 投 資 信 託 受 益 証 券         | 5,826      | 0.0   |
| 投 資 証 券                 | 237,430    | 2.0   |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 335,840    | 2.8   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 11,946,659 | 100.0 |

(注1) 当期末における外貨建純資産(11,940,699千円)の投資信託財産総額(11,946,659千円)に対する比率は100.0%です。

(注2) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

|                     |                   |                    |
|---------------------|-------------------|--------------------|
| 1米ドル=143.49円        | 1カナダドル=108.95円    | 1ユーロ=156.48円       |
| 1イギリスポンド=182.69円    | 1スイスフラン=160.15円   | 1スウェーデンクローナ=13.40円 |
| 1ノルウェークローネ=13.28円   | 1デンマーククローネ=21.01円 | 1オーストラリアドル=95.77円  |
| 1ニュージーランドドル=88.32円  | 1香港ドル=18.32円      | 1シンガポールドル=106.19円  |
| 1イスラエルシェケル=39.5827円 |                   |                    |

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

| 項 目                | 当 期 末<br>2023年6月26日現在 |
|--------------------|-----------------------|
| (A) 資 産            | 11,951,922,769円       |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等    | 211,176,017           |
| 株 式(評価額)           | 11,367,563,200        |
| 投資信託受益証券(評価額)      | 5,826,601             |
| 投資証券(評価額)          | 237,430,115           |
| 未 収 入 金            | 5,337,345             |
| 未 収 配 当 金          | 14,591,712            |
| 差 入 委 託 証 拠 金      | 109,997,779           |
| (B) 負 債            | 6,499,776             |
| 未 払 金              | 6,467,334             |
| 未 払 解 約 金          | 32,431                |
| 未 払 利 息            | 11                    |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 11,945,422,993        |
| 元 本                | 9,095,211,203         |
| 次 期 繰 越 損 益 金      | 2,850,211,790         |
| (D) 受 益 権 総 口 数    | 9,095,211,203口        |
| 1万口当たり基準価額(C/D)    | 13,134円               |

### ■損益の状況

| 項 目                    | 当 期<br>自 2022年6月28日<br>至 2023年6月26日 |
|------------------------|-------------------------------------|
| (A) 配 当 等 収 益          | 169,402,869円                        |
| 受 取 配 当 金              | 162,549,518                         |
| 受 取 利 息                | 5,136,643                           |
| そ の 他 収 益 金            | 1,723,096                           |
| 支 払 利 息                | △6,388                              |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益    | 1,857,300,519                       |
| 売 買 益                  | 2,142,093,292                       |
| 売 買 損                  | △284,792,773                        |
| (C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益  | 58,858,013                          |
| 取 引 益                  | 80,839,837                          |
| 取 引 損                  | △21,981,824                         |
| (D) そ の 他 費 用          | △13,003,352                         |
| (E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D) | 2,072,558,049                       |
| (F) 前 期 繰 越 損 益 金      | 158,687,546                         |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金    | 635,392,441                         |
| (H) 解 約 差 損 益 金        | △16,426,246                         |
| (I) 計 (E+F+G+H)        | 2,850,211,790                       |
| 次 期 繰 越 損 益 金(I)       | 2,850,211,790                       |

(注1) (B) 有価証券売買損益および(C) 先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (G) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (H) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は1,562,498,874円、期中追加設定元本額は7,654,087,485円、期中一部解約元本額は121,375,156円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

|  |                |
|--|----------------|
| 外国株式SMTBセレクション(SMA専用)                      | 5,975,380,828円 |
| DC外国株式ESGリーダーズインデックスファンド                   | 1,978,096,873円 |
| コア投資戦略ファンド(成長型)                            | 414,398,493円   |
| コア投資戦略ファンド(切替型)                            | 185,653,993円   |
| コア投資戦略ファンド(安定型)                            | 174,450,525円   |
| コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)                         | 155,144,883円   |
| サテライト投資戦略ファンド(株式型)                         | 104,285,474円   |
| POFs用 外国株式ESGリーダーズ・インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用) | 73,607,935円    |
| コア投資戦略ファンド(積極成長型)                          | 34,192,199円    |

## お知らせ

---

該当事項はありません。